We Create Fortune

2024.01.26

短期利率

昨日央行 NCD 到期 5,851.00 億元,央行發行存單 7 天及 28 天期 NCD 共 5,873.30 億元,截至昨日為止央行 NCD 未到期餘額為 78,578.50 億元。

昨日投信端資金依舊多缺不一,銀行端資金充裕,整體市場維持平穩走勢,短期利率仍是成交在區間內。公債 RP 利率主要成交在 0.93-1.03%,公司債 RP 利率成交在 1.30%-1.35%。

今日有央行 NCD 到期 3,566.00 億元。市場資金仍是呈現寬鬆態勢,目前暫時還看不出月底的緊縮效應,預料短期利率仍可持平於區間內。預估本日公債 RP 利率成交在 0.93%-1.03%,公司債 RP 成交在 1.30%-1.35%。

附:債券附條件交易牌告利率

113/01/26	10 天	20 天	30 天	60 天	90 天
RP	0.45%	0.45%	0.45%	0.45%	0.45%
RS	1.45%	1.45%	1.45%	1.45%	1.45%

We Create Fortune

2024.01.26

公債交易

央行公布 12 月理監事會議紀錄,儘管下調今年通膨預期,有多位委員關切通膨問題,未來通膨將在貨幣政策扮演重要角色,且不排除繼續緊縮的可能。昨日台債市場盤面兩年券成交在 1.13%,三十年長券則是下跌 1 b.p.至 1.56%。

國外方面,美國第四季 GDP 年增 3.3%超乎預期,PCE 物價指數初值第四季季增年率 1.7%遠低於預期,通膨有望持續放緩,但上週初領失業救濟金人數 21.4 萬人,高於預期的 20 萬人。終場十年期公債殖利率下跌 4.6 b.p.至 4.1299%。

附:收盤行情表 (last bid)

年期	指標券種	1月24日	1月25日	漲跌(b.p.)
2年	A13101	1.1300	1.1300	+0.00
5年	A13103R	1.1830	1.1830	+0.00
10年	A13104	1.2300	1.2300	+0.00
20 年	A13102	1.3850	1.3850	+0.00
30 年	A12111	1.5700	1.5600	-1.00