2024.01.12

短期利率

昨日央行 NCD 到期 3,317.80 億元，央行發行存單 7 天、28 天期 NCD 共 3,036.00 億元，截至昨日為止央行 NCD 未到期餘額為 80,524.95 億元。

昨日雖有多檔債券交割的緊縮因子，但因整體市場資金供應充足，因此並未受到太大的影響，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 3,704.25 億元，另有中油、台電及富旺公司債交割共 190 億元。今日仍有多檔債券交割，但因整體市場資金依舊寬鬆，因此預計影響有限，預料短期利率仍將成交在區間內。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

113/01/12	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%

註：本內容係取材於本公司(元大證券)認可之相關資料來源，但並不保證其完整性或正確性。
報告內容僅供參考，且不提供或嘗試遊說交易買賣之投資決策。
報告中所有的意見及預估，皆基於本公司於特訂日期所做的判斷，若有變更時本公司將不做預告。
客服專線：(02)2718-5886 (服務時間：每週一至週五 AM8：00~PM08：00)
版權所有元大證券，未經授權同意，不得將網站內容轉載於任何形式媒體 許可證號 110 年金管證總字第 0014 號

2024.01.12

公債交易

昨日市場等待美國 CPI 數據指引，台債市場交投冷清，盤面上僅 2 年券下跌 0.05 b.p.至 1.1345%。

國外方面，美國 12 月 CPI 年增 3.4%高於預期，但聯準會關注的核心 CPI 年增 3.9%低於前值的 4.0%，儘管通膨有所回升，但核心通膨走低的趨勢讓市場對聯準會降息的預期並未動搖。三十年公債中標殖利率 4.229%，為 8 月以來新低，上週初領失業救濟金人數降至 20.2 萬人，創 3 個月來新低，終場十年期公債殖利率下跌 4.7 b.p.至 3.9809%。

附：收盤行情表 (last bid)

年期	指標券種	1 月 10 日	1 月 11 日	漲跌(b. p.)
2 年	A13101	1.1350	1.1345	-0.05
5 年	A13103R	1.1500	1.1500	+0.00
10 年	A13104	1.2112	1.2112	+0.00
20 年	A13102	1.3880	1.3880	+0.00
30 年	A12111	1.5830	1.5830	+0.00

註：本內容係取材於本公司(元大證券)認可之相關資料來源，但並不保證其完整性或正確性。
報告內容僅供參考，且不提供或嘗試遊說交易買賣之投資決策。
報告中所有的意見及預估，皆基於本公司於特訂日期所做的判斷，若有變更時本公司將不做預告。
客服專線：(02)2718-5886 (服務時間：每週一至週五 AM8：00~PM08：00)
版權所有元大證券，未經授權同意，不得將網站內容轉載於任何形式媒體 許可證號 110 年金管證總字第 0014 號