2024.02.22

短期利率

昨日央行 NCD 到期 5,288.80 億元，央行發行存單 7 天、28 天及 182 天期 NCD 共 5,540.70 億元，截至昨日為止央行 NCD 未到期餘額為 77,620.45 億元。

昨日無特殊緊縮因子，且銀行端，壽險及投信大都多錢，整體貨幣市場呈現穩中偏鬆的態勢，RP 利率成交在區間內。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 6,685.75 億元。由於今日並無特別的緊縮因子，在市場資金充裕下，預計利率將持穩在近日區間內。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

113/02/22	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

2024.02.22

公債交易

昨日台債市場利率走跌，因前一日十年期新券標售結果尚佳，市場買氣稍有回籠，不過因下週還有五年期 R 券的標售，整體追價動力不強，指標十年券終場下滑 0.65bps 收在 1.222%，五年券下滑 3.35bps 收在 1.1715%。

國外方面，1 月 FOMC 會議紀要顯示多數官員對過早降息存有疑慮，需要對通膨回落有更大的信心才會考慮降息，再度削減市場對之後降息的樂觀預期，加上二十年期公債標售結果不佳，影響美債利率走揚，終場十年期美債上行 4.34bps 收在 4.3187%。

附：收盤行情表 (last bid)

年期	指標券種	2 月 20 日	2 月 21 日	漲跌(b. p.)
2 年	A13101	1.0900	1.0900	+0.00
5 年	A13103R	1.2050	1.1715	-3.35
10 年	A13104	1.2285	1.2220	-0.65
20 年	A13102	1.3550	1.3550	+0.00
30 年	A12111	1.5360	1.5360	+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