2024.02.15

短期利率

上週寬鬆因素有央行存單到期共 8,146.70 億元，緊縮因素有央行存單發行共 6,544.70 億，共減少發行 1,602.00 億元，上週因農曆年前資金需求較高，但央行適度放鬆沖銷力道，使得整體貨幣市場資金寬鬆，供需平穩，短期利率成交在區間內。30 天期自保票利率成交在 1.35%-1.40%，隔拆加權平均利率收在 0.773%，公債 RP 利率成交在 0.93%-1.03%。公司債 RP 利率成交在 1.30%-1.35%。

本週寬鬆因素有央行存單到期共 11,162.70 億元，緊縮因素有 364 天 NCD 發行 1,400 億元。本週度過了農曆年關資金需求的高峰，預料貨幣市場通貨回籠情況將逐漸顯現，在央行沖銷力道不變之下，短期利率將有微幅走低的機會。預估本週隔夜拆款成交利率在 0.65%-0.80%，公債 RP 利率成交在 0.93%-1.03%，公司債 RP 利率成交在 1.30%-1.35%。

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

2024.02.15

公債交易

台債因春節假期無交易。

國外方面，周二公布美國 1 月 CPI 年增 3.1%、月增 0.3%，核心 CPI 年增 3.9%、月增 0.4%，數據均高於經濟學家的預期，顯示通膨仍具相當的黏性，FED 3 月降息的機會渺茫，美債利率大幅走揚，昨日利率逢高出現買盤進場，終場十年期美債下滑 5.89bps 收在 4.2554%。

附：收盤行情表 (last bid)

年期	指標券種	2 月 2 日	2 月 5 日	漲跌(b. p.)
2 年	A13101	1.1000	1.1000	+0.00
5 年	A13103R	1.1570	1.1570	+0.00
10 年	A13104	1.1950	1.2225	+2.75
20 年	A13102	1.3300	1.3300	+0.00
30 年	A12111	1.5100	1.5100	+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