2024.01.30

短期利率

昨日央行 NCD 到期 3,337.00 億元，央行發行存單 7 天及 28 天期 NCD 共 3,371.00 億元，截至昨日為止央行 NCD 未到期餘額為 78,782.00 億元。

昨日整體市場供給充裕但略有分配不均，短期利率仍成交在區間內。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 3,865.50 億元。月底的緊縮效應顯現，短期利率將成交於區間上緣。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

113/01/30	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

2024.01.30

公債交易

昨日台債利率隨美債些微走揚，在 FOMC 會議前部分賣壓出籠，五年期 R 券上揚 1.7bps 收在 1.195%，十年券則上揚 1bp 收在 1.24%，不過長端券種需求仍舊熱絡，利率持續緩步下移。

國外方面，美國財政部公布最新發債計畫，今年第一季借款需求 7,600 億美元，較 10 月預估的下修 550 億美元，另外預估第二季將借款 2,020 億美元，之後美債利率走跌，十年期美債下滑 6.33bps 收在 4.074%。

附：收盤行情表 (last bid)

年期	指標券種	1 月 26 日	1 月 29 日	漲跌(b.p.)
2 年	A13101	1.1300	1.1300	+0.00
5 年	A13103R	1.1780	1.1950	+1.70
10 年	A13104	1.2300	1.2400	+1.00
20 年	A13102	1.3850	1.3560	-2.90
30 年	A12111	1.5490	1.5450	-0.40

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