2024.03.15

短期利率

昨日央行 NCD 到期 3,985.30 億元，央行發行存單 7 天、28 天期 NCD 共 3,714.10 億元，截至昨日為止央行 NCD 未到期餘額為 79,317.80 億元。

昨日隨台股表現亮眼，各方資金均湧入股市，在資金排擠效應之下，貨幣市場資金不似先前寬鬆，短期利率微幅走高。公債 RP 利率主要成交在 0.95-1.05%，公司債 RP 利率成交在 1.30%-1.40%。

今日有央行 NCD 到期 4,502.00 億元，另有公債 A13201 期及台積電公司債發行共 428 億。持續受到台股 ETF 募集熱潮影響，在資金排擠效應之下，市場短期資金變少，短期利率仍有走升的壓力。預估本日公債 RP 利率成交在 0.95%-1.05%，公司債 RP 成交在 1.30%-1.40%。

附：債券附條件交易牌告利率

113/03/15	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

2024.03.15

公債交易

昨日台債市場在央行總裁明示六月前不降息下，長端冷券成交利率上升 1-2 b.p.，而指標券種仍未成交。

國外方面，美國上週初領事業救濟金人數降至 20.9 萬人，而 2 月 PPI 年增 1.6%，月增 0.6%，雙雙高於預期，2 月零售銷售月增 0.6%則是低於預期，顯示消費者在通膨環境下對價格更加敏感，終場十年期公債殖利率上漲 10.2 b.p.至 4.2923%。

附：收盤行情表 (last bid)

年期	指標券種	3 月 13 日	3 月 14 日	漲跌(b. p.)
2 年	A13101	1.0900	1.0900	+0.00
5 年	A13103	1.1800	1.1800	+0.00
10 年	A13104	1.2041	1.2041	+0.00
20 年	A13102	1.3150	1.3150	+0.00
30 年	A12111	1.5085	1.5085	+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