

2024.04.17

短期利率

昨日央行 NCD 到期 4,753.50 億元，央行發行存單 7 天、28 天期 NCD 共 4,140.00 億元，截至昨日為止央行 NCD 未到期餘額為 76,732.85 億元。

昨日雖有公司債交割的緊縮因子，但因目前市場資充裕下，並未受到影響，短期利率仍是成交在區間內。公債 RP 利率主要成交在 1.07-1.15%，公司債 RP 利率成交在 1.40%-1.50%。

今日有央行 NCD 到期 3,053.00 億元。由於目前貨幣市場短期資金供應充沛，加上今日無大型的緊縮因素影響，預料短期利率走勢仍走穩在近期區間內。預估本日公債 RP 利率成交在 1.07%-1.15%，公司債 RP 成交在 1.40%-1.50%。

附：債券附條件交易牌告利率

113/04/17	10 天	20 天	30 天	60 天	90 天
RP	0.55%	0.55%	0.55%	0.55%	0.55%
RS	1.55%	1.55%	1.55%	1.55%	1.55%

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

2024.04.17

公債交易

昨日台債市場標售十年期增額券，得標利率 1.67% 大幅劣於市場預期的區間 1.53-1.57%，較前次同年期躍升 43.1bps，得標比重分別為銀行業 75.14%、證券業 19.43%、票券業 5.14% 及保險業 0.29%，得標倍數僅 1.17 為近年新低，顯示買盤仍相當保守，終場指標十年券 A13107 彈升 13.4bps 收在 1.68%，指標五年券則首次成交在 1.55%。

國外方面，FED 主席鮑爾表示，可能需要比之前預期更長的時間維持在高利率水平，近期的通膨數據並未給官員們足夠的信心很快降息，言論打擊美債走勢，利率全線走高，終場十年期美債彈升 6.6bps 收在 4.6674%。

附：收盤行情表 (last bid)

年期	指標券種	4月15日	4月16日	漲跌(b. p.)
2年	A13101	1.0900	1.0900	+0.00
5年	A13105	-	1.5500	+0.00
10年	A13107	1.5460	1.6800	+13.40
20年	A13102	1.5075	1.5075	+0.00
30年	A12111	1.7500	1.7500	+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