2024.03.13

短期利率

昨日央行 NCD 到期 795.50 億元，央行發行存單 7 天、28 天期 NCD 共 1,238.00 億元，截至昨日為止央行 NCD 未到期餘額為 78,923.00 億元。

昨日雖然投信端的資金多缺不一，但因市場資金仍屬充足，對 RP 利率走勢影響不大，RP 利率仍是維持在區間內。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 646.00 億元。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，短期利率有慢慢走升的壓力。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

113/03/13	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

2024.03.13

公債交易

2 年期公債得標利率 1.135%，投標倍數 1.43 倍，得標比重分別為銀行業 76%、證券業 10.5%、票券業 6.67%、保險業 7.5%。在台灣知名智庫主任表示央行有可能在下半年反向升息來打壓通膨下，台債利率走升，五年期公債殖利率上漲 0.9 b.p.至 1.18%。

國外方面，美國 2 月 CPI 年增 3.2%、月增 0.4%，而核心 CPI 年增 3.8%、月增 0.4%雙雙高於市場預期，顯示通膨在最後一哩路仍具有黏性，終場十年期公債殖利率上升 5.3 b.p.至 4.1507%。

附：收盤行情表 (last bid)

年期	指標券種	3 月 11 日	3 月 12 日	漲跌(b.p.)
2 年	A13101	1.0900	1.0900	+0.00
5 年	A13103	1.1710	1.1800	+0.90
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