2024.03.08

短期利率

昨日央行 NCD 到期 3,118.00 億元，央行發行存單 7 天、28 天期 NCD 共 2,326.50 億元，截至昨日為止央行 NCD 未到期餘額為 78,128.50 億元。

昨日投信端有部分遭到贖回，壽險與銀行都能續作，供需之間尚稱平穩，短期利率仍是成交在區間內。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 890.00 億元。投信端依舊多缺不一，整體市場呈現穩中偏多格局，預料 RP 利率將持穩於區間內。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

113/03/08	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

2024.03.08

公債交易

隨著美債利率下滑，昨日台債市場也跟進下探，指標五年券突破 1.17%關卡來到 1.169%，較前一日下滑 0.55bps，但十年券在接近 1.2%關卡時因下方空間有限，遭遇較大阻力，終場收在 1.2041%，較前一日下滑 0.79bps。台灣 2 月 CPI 年增率再度突破 3%，漲幅 3.08%為十九個月新高，核心 CPI2.9%。

國外方面，ECB 宣布維持利率不變，符合市場預期，行長拉加德表示預料通膨將續呈下行趨勢，對實現目標更有信心，提升今年下半年後的降息可能，會後提振了美債走勢。美國最新初領失業救濟金人數 21.7 萬人，略高於預期一千人，但續領失業金人數 190.6 萬人高於預期的 188 萬人。終場十年期美債下滑 1.93bps 收在 4.0827%。

附：收盤行情表 (last bid)

年期	指標券種	3 月 6 日	3 月 7 日	漲跌(b. p.)
2 年	A13101	1.0900	1.0900	+0.00
5 年	A13103	1.1745	1.1690	-0.55
10 年	A13104	1.2120	1.2041	-0.79
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