

2024.04.24

短期利率

昨日央行 NCD 到期 3,856.50 億元，央行發行存單 7 天、28 天期共 3,941.00 億元，截至昨日為止央行 NCD 未到期餘額為 77,492.55 億元。

昨日短錢充裕，利率大致持穩，成交在區間下緣。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 3,207.00 億元及公司債交割 440 億元。月內短錢充斥下，預料短期利率有機會壓低但幅度小。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

113/04/24	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%

2024.04.24

公債交易

3 月份製造業生產指數 92.49，年增 4.01%，主因受惠人工智慧、高速運算與雲端資料服務等需求成長，資訊電子產業生產動能續強，惟傳統產業需求回升力道不足續呈減產，抵銷部分增幅。週一五年券開標後第二季再無同年期之發行前交易，在缺乏空方因素後買盤向下追價，終場五年券殖利率向下收在 1.586%，而十年券仍未成交。

國外方面，3 月美國 S&P 製造業 PMI 下滑至 49.9、服務業 PMI 下滑至 50.9，雙雙不如預期，主要受原物料價格與通膨影響所拖累。2 年期美債標售需求強勁，得標利率 4.898% 低於發行前交易，帶動公債殖利率下跌，終場 10 年期美國公債下跌 0.8 b.p. 至 4.6004%。

附：收盤行情表 (last bid)

年期	指標券種	4 月 22 日	4 月 23 日	漲跌(b. p.)
2 年	A13101	1.4500	1.4500	+0.00
5 年	A13105	1.6300	1.5860	-4.40
10 年	A13107	1.6680	1.6680	+0.00
20 年	A13102	1.8100	1.8100	+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