

2024.04.09

短期利率

昨日央行 NCD 到期 5,324.00 億元，央行發行存單 7 天、28 天及 364 天期 NCD 共 4,775.00 億元，截至昨日為止央行 NCD 未到期餘額為 76,396.85 億元。

昨日雖有 364 天期 NCD 及遠東新公司債交割的緊縮因子，但在市場資金仍然充裕下，並未受到太大的影響，短期利率仍是成交在區間內。公債 RP 利率主要成交在 1.05-1.15%，公司債 RP 利率成交在 1.40%-1.50%。

今日有央行 NCD 到期 1,438.00 億元。今日無特殊的緊縮因子影響，整體市場呈現穩中偏鬆的態勢，短期利率仍將成交在區間內。預估本日公債 RP 利率成交在 1.05%-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

113/04/09	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

2024.04.09

公債交易

週一市場受到美債殖利率反彈影響，十年券報價同步上移，但盤面上仍受近期台債偏空的氣氛影響而未有指標券成交。

國外方面，隨著近期各項強勁的數據令市場預期聯準會降息時程將放緩，債券殖利率震盪走高，市場等待週三美國 CPI 數據做出更多的指引，終場十年期公債殖利率上揚 1.6 b.p.至 4.4178%。

附：收盤行情表 (last bid)

年期	指標券種	4月3日	4月8日	漲跌(b. p.)
2年	A13101	1.0900	1.0900	+0.00
5年	A13103	1.3750	1.3750	+0.00
10年	A13107	1.4640	1.4640	+0.00
20年	A13102	1.5075	1.5075	+0.00
30年	A12111	1.6750	1.6750	+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