

2020.09.11

## 短期利率

昨日央行 NCD 到期 3,946.50 億元，央行發行 7 天及 28 天期存單共 3,862.50 億元，截至本週三為止 NCD 未到期餘額為 82,974.30 億元。

昨日台幣資金市況持續平穩，無特殊情形，短票和債券依舊缺券，綜觀在全球央行大量投注流動性下，目前不論台、外幣資金情勢皆十分寬鬆，預料此情勢將持續。昨日公債 RP 區間在 0.21%-0.24%，公司債 RP 區間在 0.30%~0.33%。

今日央行 NCD 到期金額 493.0 億元，另今日無公司債發行案件，持續關注目前 RP 水準下的市場資金動態。預估公債 RP 利率將成交在 0.20~0.23%，公司債 RP 將成交在 0.30%~0.33%。

### 附：債券附條件交易牌告利率

109/09/11	10 天	20 天	30 天	60 天	90 天
RP	0.15%	0.15%	0.15%	0.15%	0.15%
RS	1.15%	1.15%	1.15%	1.15%	1.15%

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 109 年金管證總字第 0007 號

2020.09.11

## 公債交易

昨日台債市場交投依然不踴躍，雖然週三晚間美債突破 0.7% 關卡，不過台灣十年期指標債則是向下收在本週低點，終場下滑 0.37bp 以 0.4163% 作收，五年券沒有成交。台債在缺乏方向指引下，量能持續不足，預料後市仍將陷於區間整理格局。

昨日美股尾盤由紅翻黑，科技股再反彈一日後顯得疲弱，且美國上週初申請失業救濟人數達 88.4 萬人叫前週增加約 9 萬人，市場擔憂疫情持續拖累勞力市場的復甦。美債市場殖利率回落，十年券跌破 0.7% 收在 0.6837%，新標售的三十年券也獲得較強勁的需求，不過觀察美債目前亦是陷於狹幅區間震盪，待下週 FOMC 會議為市場帶來更多指標性的消息。

### 附：收盤行情表 (last bid)

年期	指標券種	9月9日	9月10日	漲跌(b. p.)
2年	A08111	0.1500%	0.1500%	0.00
5年	A09107	0.3350%	0.3350%	0.00
10年	A09106	0.4200%	0.4163%	-0.37
20年	A09104	0.5150%	0.5150%	0.00
30年	A09105	0.5801%	0.5801%	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 109 年金管證總字第 0007 號