2024.03.29

短期利率

昨日央行 NCD 到期 3,516.80 億元，央行發行存單 7 天、28 天期 NCD 共 3,245.50 億元，截至昨日為止央行 NCD 未到期餘額為 76,602.35 億元。

昨日因應季底緊縮效應，投信端贖回壓力仍在，而銀行端對利率較為堅持，帶動債券 RP 利率持續成交在高檔。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 2,957.00 億元。月底最後一個交易日，仍將面臨一些例行性的贖回，市場資金仍然偏緊，預期短期利率仍將成交在利率區間高檔。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

113/03/29	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

2024.03.29

公債交易

週四在市場消化央行總裁的鴿派言論後，短天期殖利率回跌，五年券下跌 4.5 b.p.至 1.34%，十年券下跌 3 b.p.至 1.43%。

國外方面，美國三月份密大消費者信心指數上修至 79.4，較初值上升 2.9，達 21 年 7 月以來的最高，而一年期通脹預期自 2 月的 3%下滑至 2.9%。而去年第四季 GDP 終值上修至 3.4%，經濟仍比預期具韌性，終場十年期公債殖利率上漲 1 b.p.至 4.20%。

附：收盤行情表 (last bid)

年期	指標券種	3 月 27 日	3 月 28 日	漲跌(b.p.)
2 年	A13101	1.0900	1.0900	+0.00
5 年	A13103	1.3850	1.3400	-4.50
10 年	A13107	1.4600	1.4300	-3.00
20 年	A13102	1.4900	1.4900	+0.00
30 年	A12111	1.6500	1.6500	+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