2024.03.14

短期利率

昨日央行 NCD 到期 646.00 億元，央行發行存單 7 天、28 天及 182 天期 NCD 共 1,312.00 億元，截至昨日為止央行 NCD 未到期餘額為 79,589.00 億元。

昨日投信端的資金仍多缺不一，但整體市場資金仍充足，對 RP 利率走勢影響不大，RP 利率仍維持在區間內。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 3,985.30 億元。隨資金湧入股市，在資金排擠效應下，貨幣市場資金似不若先前寬鬆，短期利率有走升的壓力。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

113/03/14	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

2024.03.14

公債交易

昨日市場等待央行總裁赴立院報告結果，盤面上交投冷清，指標券種皆未成交。

國外方面，儘管美國新發行 30 年期公債中標殖利率低於發行前交易 2.1 b.p.，債市在聯準會緘默期間缺乏指引而普遍走跌，終場十年期公債殖利率上漲 4.3 b.p.至 4.1938%。

附：收盤行情表 (last bid)

年期	指標券種	3 月 12 日	3 月 13 日	漲跌(b. p.)
2 年	A13101	1.0900	1.0900	+0.00
5 年	A13103	1.1800	1.1800	+0.00
10 年	A13104	1.2041	1.2041	+0.00
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