2024.03.27

短期利率

昨日央行 NCD 到期 3,909.00 億元，央行發行存單 7 天、28 天期 NCD 共 3,922.50 億元，截至昨日為止央行 NCD 未到期餘額為 76,720.65 億元。

昨日有環球晶及國泰金債券交割的緊縮因子，及月底季底將有些例行性支出現，市場資金需求較大，短期利率往利率區間高檔靠攏。公債 RP 利率主要成交在 1.03-1.15%，公司債 RP 利率成交在 1.40%-1.50%。

今日有央行 NCD 到期 2,708.00 億元，另有高市債、玉山金及王道銀金融債交割共 154 億元。今日仍有債券交割的緊縮因子，市場資金需求仍大，預期短期利率仍將往利率區間高檔移動。預估本日公債 RP 利率成交在 1.03%-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

113/03/27	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

2024.03.27

公債交易

週二台債市場氣氛依舊偏空，五年券仍有停損賣壓出籠，而發行前交易的十年券在停損結束後開始有交易商進場做空，使殖利率高居不下，五年券上升 1.9 b.p.至 1.385%，十年券上升 3 b.p.至 1.46%。

國外方面，美國 2 月耐久財訂單月增 1.4%，高於市場預期的 1.2%，主因運輸設備和機械訂單增加，顯示美國製造業有逐漸復甦的跡象，終場十年期公債殖利率下跌 1.4 b.p.至 4.2316%。

附：收盤行情表 (last bid)

年期	指標券種	3 月 25 日	3 月 26 日	漲跌(b.p.)
2 年	A13101	1.0900	1.0900	+0.00
5 年	A13103	1.3660	1.3850	+1.90
10 年	A13107	1.4300	1.4600	+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