

2024.04.19

## 短期利率

昨日央行 NCD 到期 6,011.50 億元，央行發行存單 7 天、28 天及二年期 NCD 共 5,686.50 億元，截至昨日為止央行 NCD 未到期餘額為 76,790.85 億元。

昨日市場資金平穩充裕，短期利率沒什麼變化，仍是成交在舊有區間內。公債 RP 利率主要成交在 1.07-1.15%，公司債 RP 利率成交在 1.40%-1.50%。

今日有央行 NCD 到期 3,753.60 億元，另有公債交割 350 億元。今日雖有公債交割的緊縮因子，但因整體市場資金充足，因此預計影響有限，預料短期利率仍將成交在區間內。預估本日公債 RP 利率成交在 1.07%-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

113/04/19	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%

2024.04.19

## 公債交易

昨日在美債利率止彈後，台債市場也暫時得以喘息，短端出現較大量的買盤進場承接，指標五年券下行 3bps 收在 1.59%，但短券是否回穩仍須看下週一五年券的標售情形。

國外方面，美國最新經季節調整後首次申請失業救濟金人數 21.2 萬人，持平於前周修正值，優於經濟學家平均預估的 21.5 萬人，顯示勞動市場持續維持韌性。亞特蘭大聯儲總裁 Bostic 表示，通膨回落至 2% 的速度比預期的慢，暗示要到今年年底才能降息。終場十年期美債上揚 4.53bps 收在 4.6326%。

### 附：收盤行情表 (last bid)

年期	指標券種	4 月 17 日	4 月 18 日	漲跌(b. p.)
2 年	A13101	1.5020	1.4500	-5.20
5 年	A13105	1.6200	1.5900	-3.00
10 年	A13107	1.7250	1.7250	+0.00
20 年	A13102	1.5075	1.5075	+0.00
30 年	A12111	1.7500	1.7500	+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