

2020.10.13

## 短期利率

昨日央行 NCD 到期 6,905.50 億元，央行發行 7 天及 28 天期存單共 6,334.50 億元，截至昨日為止 NCD 未到期餘額為 83,035.70 億元，另今日無公司債初級案件。

月中資金陸續回籠，搭配台幣升值助益，貨幣市場狀態明顯寬鬆，市場短票、拆款及債券 RP 利率皆有逐漸下滑趨勢。昨日公債 RP 區間在 0.20%-0.23%，公司債 RP 區間在 0.28%~0.32%。

今日央行 NCD 到期金額 4,638 億元，預計因市場資金充裕，近期 RP 利率將呈緩步下滑走勢。預估公債 RP 利率將成交在 0.19~0.22%，公司債 RP 將成交在 0.28%~0.32%。

### 附：債券附條件交易牌告利率

109/10/13	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

2020.10.13

## 公債交易

昨日台債市場受十年券空單回補影響，殖利率持續下探歷史新低，台幣持續強勢、熱錢湧入使資金過剩，在強勁買氣的帶動下，終場十年指標債收在 0.33%，較前日下滑 1.8bps，五年券則下滑 0.97bps 收於 0.2403%。

美股昨日由科技股帶頭上攻，5G iPhone 推出前夕蘋果股價勁揚 6.4%，全球最大電商購物節會員日也即將開跑，Amazon 股價亦上漲了 4.8%，上週五白宮將紓困規模提升至 1.8 兆美元，與民主黨所希望的 2.2 兆美元落差縮小，市場對於協商結果樂觀看待，昨日美債休市，上週美國三十年期公債期貨淨空單創歷史高位，反應了長券利率走升的預期。

### 附：收盤行情表 (last bid)

年期	指標券種	10月8日	10月12日	漲跌(b. p.)
2年	A08111	0.0950%	0.0950%	-0.00
5年	A09107	0.2500%	0.2403%	-0.97
10年	A09109	0.3480%	0.3300%	-1.80
20年	A09108	0.4898%	0.4898%	-0.00
30年	A09105	0.5500%	0.5500%	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