We Create Fortune

2024.03.21

短期利率

昨日央行 NCD 到期 5,706.70 億元,央行發行存單 7 天、28 天期 NCD 共 5,355.20 億元,截至 昨日為止央行 NCD 未到期餘額為 77,422.35 億元。

昨日投信端有不少資金流入,銀行及壽險資金也是偏多,短期利率成交在區間內。公債 RP 利率主要成交在 0.95-1.05%,公司債 RP 利率成交在 1.30%-1.40%。

今日有央行 NCD 到期 5,876.80 億元。月底前短錢充斥,市場資金充裕,短期利率將持穩在區間內。預估本日公債 RP 利率成交在 0.95%-1.05%,公司債 RP 成交在 1.30%-1.40%。

附:債券附條件交易牌告利率

113/03/21	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%



We Create Fortune

2024.03.21

公債交易

昨日台債市場指標五年券持續收升,市場擔憂台灣央行可能再度祭出緊縮貨幣政策,短券賣 壓承重,終場五年券上揚 2.9bps 收在 1.244%。

國外方面,FOMC 會議結果如市場預期,維持基準利率在 5.25-5.5%不變,聲明中上修經濟成長並下修失業率的預估值,原先市場擔憂在最近通膨數據高於預期下,FED 會改變今年的降息幅度,不過本次點陣圖仍顯示今年預計降息三碼,鮑爾在會後記者會也表示目前並未改變通膨正在緩步降溫的趨勢,提振市場樂觀氣氛,美債止跌反彈,十年期美債利率終場下滑1.97bps 收在 4.2728%。

附:收盤行情表 (last bid)

119 1/2 1/3 1/3 1/2	Name 13 1/3 PC (constant)					
年期	指標券種	3月19日	3月20日	漲跌(b.p.)		
2年	A13101	1.0900	1.0900	+0.00		
5年	A13103	1.2150	1. 2440	+2.90		
10 年	A13104	1.2041	1.2041	+0.00		
20 年	A13102	1.3960	1.3960	+0.00		
30 年	A12111	1.6055	1.6010	-0.45		