We Create Fortune

2024.03.28

短期利率

昨日央行 NCD 到期 2,708.00 億元,央行發行存單 7 天、28 天及 182 天期 NCD 共 2,861.00 億元,截至昨日為止央行 NCD 未到期餘額為 76,873.65 億元。

昨日仍有債券交割的緊縮因子,市場資金需求強,短期利率緩步走高,但仍在區間內。公債 RP 利率主要成交在 1.05-1.15%,公司債 RP 利率成交在 1.40%-1.50%。

今日有央行 NCD 到期 3,516.80 億元,另有潤隆公司債交割共 20 億元。今日仍有債券交割的緊縮因子,加上月底出現例行性贖回,市場資金偏緊,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 1.05%-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

113/03/28	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%



We Create Fortune

2024.03.28

公債交易

台灣二月景氣信號燈升至 29 分,較前月增加 2 分,主因 AI 應用擴增以及部份產業庫存回補,國內景氣持續復甦,週三台債市場開盤氣氛仍然偏空,但央行總裁在立法院表示即使夏季通膨超過 2%也不會升息,偏鴿的態度緩解債市壓力,終場十年券小跌 0.5 b.p.至 1.455%。

國外方面,聯準會理事沃勒在公開談話中表示不急於降息,但市場並未受太大影響,七年期 美國公債招標優於預期,中標殖利率較發行前交易低 0.8 b.p.帶動債券市場走高,終場十年期 公債殖利率下跌 3.9 b.p.至 4.1923%。

附:收盤行情表 (last bid)

年期	指標券種	3月26日	3月27日	漲跌(b.p.)
2年	A13101	1.0900	1.0900	+0.00
5年	A13103	1.3850	1.3850	+0.00
10年	A13107	1.4600	1.4550	-0.50
20 年	A13102	1.4900	1.4900	+0.00
30 年	A12111	1.6500	1.6500	+0.00