**2024.03.19**

## 短期利率

昨日央行 NCD 到期 4,843.00 億元，央行發行存單 7 天、28 天期及二年期 NCD 共 4,288.05 億元，截至昨日為止央行 NCD 未到期餘額為 78,318.35 億元。

昨日市場依舊是多缺不一，但要軋平資金不難，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 4,983.00 億元，另有國庫券財 113-5 期交割 300 億元。今日有國庫券交割的緊縮因子，市場資金會略微偏緊，但短期利率仍是成交在區間內。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

| 113/03/19 | 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% |

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

**2024.03.19**

## 公債交易

昨日台債市場長券賣壓持續，加上美債利率續彈，整體氣氛依舊偏空，市場保守觀望本週 FOMC 及央行理監事會議的到來，指標五年及十年券無成交。

國外方面，本週即將迎來多國央行利率決策會議，市場交投轉趨清淡，在美國上週一系列數據的影響下，市場持續下修對今年的降息預期，美債走勢疲軟，昨日十年期美債上揚 1.79bps 收在 4.3242%。

附：收盤行情表 (last bid)

| 年期 | 指標券種 | 3 月 15 日 | 3 月 18 日 | 漲跌(b.p.) |
|---|---|---|---|---|
| 2 年 | A13101 | 1.0900 | 1.0900 | +0.00 |
| 5 年 | A13103 | 1.1800 | 1.1800 | +0.00 |
| 10 年 | A13104 | 1.2041 | 1.2041 | +0.00 |
| 20 年 | A13102 | 1.3630 | 1.3630 | +0.00 |
| 30 年 | A12111 | 1.5800 | 1.5800 | +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