

2024.04.23

短期利率

昨日央行 NCD 到期 3,481.20 億元，央行發行存單 7 天、28 天期共 3,738.00 億元，截至昨日為止央行 NCD 未到期餘額為 77,408.05 億元。

昨日市場資金充裕，短期利率大致持穩，成交在區間下緣。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 3,856.50 億元及公司債交割 44 億元。市場月內短錢充斥下，預料短期利率成交在區間內。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

113/04/23	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%

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

2024.04.23

公債交易

台灣 3 月外銷訂單 471.6 億美元，月增 25.0%，年增 1.2%，主因高效能運算、人工智慧及雲端產業等需求持續擴增，惟傳統貨品需求尚未明顯回升，抵銷部分增幅。週一五年期新券得標利率 1.63%，得標比重銀行業 91.17%、證券業 8%、票券業 0.83%，投標倍數 1.63 倍，開標後有部分買盤以低於 1.63% 的利率報價意圖拿券，但在賣方惜售下開標後仍未成交。

國外方面，在沒有重大總經數據的影響下，市場等待本週 2、5、7 年期總共 1,830 億元的公債發行結果，大量的發行考驗市場對美國公債的胃納量，十年期公債殖利率下跌 0.4 b.p. 至 4.6167%。

附：收盤行情表 (last bid)

年期	指標券種	4 月 19 日	4 月 22 日	漲跌(b. p.)
2 年	A13101	1.4500	1.4500	+0.00
5 年	A13105	1.5900	1.6300	+4.00
10 年	A13107	1.6680	1.6680	+0.00
20 年	A13102	1.8100	1.8100	+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