2024.02.29

短期利率

昨日央行 NCD 到期 3,664.50 億元，央行發行存單 7 天、28 天期 NCD 共 3,845.00 億元，截至昨日為止央行 NCD 未到期餘額為 78,204.20 億元。

昨日月底最後二個交易日，雖有些例行性贖回出現，不過在市場資金充沛下，影響有限，短期利率仍是成交在區間內。公債 RP 利率主要成交在 0.93-1.03%，公司債 RP 利率成交在 1.30%-1.35%。

今日有央行 NCD 到期 7,441.50 億元。月底最後一個交易日，仍會有些例行性贖回出現，不過在市場資金充足下，預計影響有限，短期利率仍將成交在區間內。預估本日公債 RP 利率成交在 0.93%-1.03%，公司債 RP 成交在 1.30%-1.35%。

附：債券附條件交易牌告利率

113/02/29	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

2024.02.29

公債交易

台灣一月外銷訂單年增 1.9%至 484.2 億美元，主因 AI 需求強勁及農曆年前備貨需求所致。第四季經常帳順差 348.4 億美元，較去年同期增加 117.4 億。週二台債市場在月底交投冷清，僅 5 年券成交一支在 1.176%。

國外方面，美國第四季 GDP 年增率修正值為 3.2%，較初值下修 0.1%，主要反應存貨投資下調，而第四季核心 PCE 年增率修正值為 2.1%，較初值上升 0.1%，數據上修顯示通膨壓力存在，終場十年期公債殖利率下跌 3.5 b.p.至 4.2678%。

附：收盤行情表 (last bid)

年期	指標券種	2 月 26 日	2 月 27 日	漲跌(b. p.)
2 年	A13101	1.0900	1.0900	+0.00
5 年	A13103R	1.1780	1.1760	-0.20
10 年	A13104	1.2225	1.2225	+0.00
20 年	A13102	1.3510	1.3510	+0.00
30 年	A12111	1.5355	1.5355	+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