

2020.10.16

### 短期利率

昨日央行 NCD 到期 1,610.00 億元，央行發行 7 天及 28 天期存單共 2,138.00 億元，截至昨日為止 NCD 未到期餘額為 83,764.70 億元，另今日無公司債初級案件。

昨日貨幣市場無特殊情事，維持過往寬鬆狀態。昨日公債 RP 區間在 0.20%-0.23%，公司債 RP 區間在 0.28%~0.32%。

今日央行 NCD 到期金額 512 億元，預計因市場資金充裕，近期 RP 利率仍有機會呈緩步下滑走勢。預估公債 RP 利率將成交在 0.19~0.22%，公司債 RP 將成交在 0.28%~0.32%。

#### 附：債券附條件交易牌告利率

| 109/10/16 | 10 天  | 20 天  | 30 天  | 60 天  | 90 天  |
|-----------|-------|-------|-------|-------|-------|
| RP        | 0.15% | 0.15% | 0.15% | 0.15% | 0.15% |
| RS        | 1.15% | 1.15% | 1.15% | 1.15% | 1.15% |

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 109 年金管證總字第 0007 號

2020.10.16

## 公債交易

昨日台債市場交投依然冷清，在近期殖利率創新後各方追價意願低落，最新的兩年期 NCD 連續 14 個月下跌，得標平均加權利率為 0.239%，較前次下滑 2.3bps，終場指標十年券沒有成交，096 成交在 0.336% 上揚 0.6bp，五年券成收平於歷史低點 0.23%。

歐洲疫情持續惡化，各國紛紛祭出社交活動限制，而美國財政刺激法案難產，又遇疫苗試驗暫緩，且美國勞工部公布上週初領失業金人數 89.9 萬人，較前週增加了 5.3 萬人高於市場預期，美股三大指數開盤紛紛走跌，十年期美債殖利率也一度跌破 0.7% 的關卡，終場美股跌勢收斂，避險買盤退場後美債也吐回先前的漲幅，十年券殖利率回到 0.739% 的水位。

### 附：收盤行情表 (last bid)

| 年期  | 指標券種   | 10月14日  | 10月15日  | 漲跌(b. p.) |
|-----|--------|---------|---------|-----------|
| 2年  | A08111 | 0.0800% | 0.0800% | 0.00      |
| 5年  | A09107 | 0.2300% | 0.2300% | 0.00      |
| 10年 | A09109 | 0.3010% | 0.3010% | 0.00      |
| 20年 | A09108 | 0.4898% | 0.4898% | 0.00      |
| 30年 | A09105 | 0.5500% | 0.5500% | 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 109 年金管證總字第 0007 號