2024.03.06

短期利率

昨日央行 NCD 到期 1,770.20 億元，央行發行存單 7 天、28 天期 NCD 共 2,229.20 億元，截至昨日為止央行 NCD 未到期餘額為 78,107.00 億元。

昨日提存期初，加上月初市場資金需求不高，整體市場資金情勢寬鬆，短期利率成交在區間內。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 1,141.50 億元，另有富邦金及世界先進公司債交割共 130 億元。今日雖有大量公司債交割的緊縮因子，但在整體市場資金充裕下，預計影響有限，預期短期利率將成交在區間內。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

113/03/06	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

2024.03.06

公債交易

昨日台債市場長短端走勢不一，短券受美債帶動以及資金成本壓力出現少量賣盤，利率微幅上行 0.4bps 收在 1.176%，但長券持續受到市場青睞，利率連日以小碎步方式下行，指標二十年券較前一日下滑 0.5bps 收在 1.315%。

國外方面，美國 2 月 ISM 服務業指數下滑至 52.6，儘管訂單及商業活動成長加速，但在價格支付指數上有所下降，雇傭指數也下降至 48 到了榮枯線之下，弱於預期的數據公布後推動美債上漲，十年期美債終場下滑 6.06bps 收在 4.1525%。

附：收盤行情表 (last bid)

年期	指標券種	3 月 4 日	3 月 5 日	漲跌(b.p.)
2 年	A13101	1.0900	1.0900	+0.00
5 年	A13103	1.1720	1.1760	+0.40
10 年	A13104	1.2120	1.2120	+0.00
20 年	A13102	1.3200	1.3150	-0.50
30 年	A12111	1.5160	1.5085	-0.75

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