

2024.04.16

## 短期利率

昨日央行 NCD 到期 4,258.05 億元，央行發行存單 7 天、28 天期 NCD 共 3,771.45 億元，截至昨日為止央行 NCD 未到期餘額為 77,346.35 億元。

昨日投信端資金出現多缺不一，但因銀行及壽險資金充足，到單大多能續作，短期利率成交在區間內。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 4,753.50 億元，另有統一公司債交割 54.5 億元。雖有公司債交割的緊縮因子，但因目前市場資充裕下，預計影響有限，預料短率仍將成交在區間內。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

113/04/16	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

2024.04.16

## 公債交易

昨日台債市場指標五年及十年券均無成交，市場靜待今日十年期增額券的標售結果，雖然前一日美債利率下滑，但並未帶來提振效果，尤其短端賣壓沉重，整條殖利率曲線更趨平坦。

國外方面，美國 3 月零售銷售成長 0.7%，高於市場預期的 0.3%，用於計算 GDP 的「對照組」躍升 1.1%，為去年年初以來最大增幅，2 月數據也被上修，顯示消費者的需求仍具韌性，再度打擊市場對降息的預期，十年期美債利率終場彈升 7.98bps 收在 4.6014%。

### 附：收盤行情表 (last bid)

年期	指標券種	4 月 12 日	4 月 15 日	漲跌(b. p.)
2 年	A13101	1.0900	1.0900	+0.00
5 年	A13103	1.4200	1.4200	+0.00
10 年	A13107	1.5460	1.5460	+0.00
20 年	A13102	1.5075	1.5075	+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