

2024.04.18

短期利率

昨日央行 NCD 到期 3,053.20 億元，央行發行存單 7 天、28 天期 NCD 共 3,436.20 億元，截至昨日為止央行 NCD 未到期餘額為 77,115.85 億元。

昨日由於貨幣市場短期資金供應充沛，加上無大型的緊縮因素影響，短期利率走勢仍走穩在近期區間內。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 6,011.50 億元，另有二年期 NCD 交割 250 億元。投信端資金多缺不一，但銀行及壽險資金充裕，整體市場呈現穩中偏多格局，預料短期利率將持穩於區間內。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

113/04/18	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

2024.04.18

公債交易

昨日在美債利率上揚的刺激下，台債市場利率也持續向上彈升，在十年期增額券標售後市場信心薄弱，整條殖利率曲線大幅向上修正，指標五年券上揚 7bps 收在 1.62%，十年券則上揚 4.5bps 收在 1.725%。

國外方面，昨日美國無重要經濟數據公布，債市賣壓稍緩，加上午後二十年期公債標售需求強勁，美債漲勢延續，終場十年期美債下滑 8.01bps 收在 4.5873%。

附：收盤行情表 (last bid)

年期	指標券種	4月16日	4月17日	漲跌(b. p.)
2年	A13101	1.0900	1.0900	+0.00
5年	A13105	1.5500	1.6200	+7.00
10年	A13107	1.6800	1.7250	+4.50
20年	A13102	1.5075	1.5075	+0.00
30年	A12111	1.7500	1.7500	+0.00