

2024.04.10

短期利率

昨日央行 NCD 到期 1,438.00 億元，央行發行存單 7 天、28 天期 NCD 共 1,838.50 億元，截至昨日為止央行 NCD 未到期餘額為 76,797.35 億元。

昨日投信端資金多缺不一，但壽險和銀行資相對較多，整體市場資金仍算充裕，短期利率成交在區間內。公債 RP 利率主要成交在 1.05-1.15%，公司債 RP 利率成交在 1.40%-1.50%。

今日有央行 NCD 到期 1,261.00 億元，另有玉山金融債交割 14.00 億元。緊縮因子的金額不大，整體市場將呈現平穩態勢，短期利率仍將成交在區間內。預估本日公債 RP 利率成交在 1.05%-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

113/04/10	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

2024.04.10

公債交易

台債市場氣氛持續偏空，昨日利率再度彈升，而在買盤退守下目前彈勢尚未止穩，指標十年券上揚 4.1bps 收在 1.505%。下午公布台灣 3 月 CPI 數據，年增 2.14% 優於市場預估的 2.51%，主因水果供給回穩，蛋價因高基期下跌抵銷了外食、房租等價格的漲幅，主計處關於預估四月 CPI 漲幅將與三月相當。

國外方面，昨日美國沒有重要的經濟數據公布，市場靜待周三 CPI 數據出爐，空單回補下令美債利率回落，十年期美債終場下滑 5.82bps 收在 4.3616%。

附：收盤行情表 (last bid)

年期	指標券種	4 月 8 日	4 月 9 日	漲跌(b. p.)
2 年	A13101	1.0900	1.0900	+0.00
5 年	A13103	1.3750	1.3750	+0.00
10 年	A13107	1.4640	1.5050	+4.10
20 年	A13102	1.5075	1.5075	+0.00
30 年	A12111	1.6750	1.6750	+0.00