

2024.04.11

短期利率

昨日央行 NCD 到期 1,261.00 億元，央行發行存單 7 天、28 天及 182 天期 NCD 共 1,647.50 億元，截至昨日為止央行 NCD 未到期餘額為 77,183.85 億元。

昨日投信端及壽險資金供給充足，整體市況維持穩中帶鬆，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 3,464.10 億元，另有南亞科公司債交割 40.00 億元。市況繼續維持寬鬆平穩的走勢，整體資金在供給無虞下，短期利率持穩在區間內。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

113/04/11	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

2024.04.11

公債交易

台灣 3 月出口 418.2 億美元，月增 33%，年增 18.9%，主要受惠於人工智慧商機持續強勁，且傳產出貨普遍回溫，今年第一季累計出超達 189 億美元，較去年成長接近 100 億美元。週二的 CPI 數據稍微緩解債市壓力，但買盤僅有逢高承接的意願，讓殖利率不易回落，終場十年券以 1.50 平盤作收。

國外方面，美國 3 月 CPI 年增 3.5%，核心 CPI 年增 3.7% 雙雙高於市場預期，消息公布後讓十年期公債殖利率直接突破 4.5% 大關，雖然後續有止穩，但午盤公布十年期公債中標利率達 4.56%，長短天期公債殖利率再創今年以來新高，終場十年期公債殖利率上漲 19.2 b.p. 到 4.5537%。

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	1.4200	+4.50
10 年	A13107	1.5050	1.5050	+0.00
20 年	A13102	1.5075	1.5075	+0.00
30 年	A12111	1.6750	1.6750	+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