

2024.09.19

短期利率

昨日央行 NCD 到期 3,160.00 億元，發行存單 7 天、28 天期 NCD 共 2,981.50 億元，截至昨日為止央行 NCD 未到期餘額為 75,030.80 億元。

昨日雖然有中油公司債交割的緊縮因子，但央行開會在即，市場短錢充斥，並未受到影響，短期利率仍是成交在區間內。公債 RP 利率主要成交在 1.10-1.12%，公司債 RP 利率成交在 1.45%-1.55%。

今日有央行 NCD 到期 1,218.80 億元，另有中油公司債交割 55.0 億元的緊縮因子。今日仍有中油公司債交割的緊縮因子，等待央行開會結果，預料短期利率仍將成交在區間內。預估本日公債 RP 利率成交在 1.10%-1.12%，公司債 RP 成交在 1.45%-1.55%。

附：債券附條件交易牌告利率

113/09/19	10 天	20 天	30 天	60 天	90 天
RP	0.60%	0.60%	0.60%	0.60%	0.60%
RS	2.00%	2.00%	2.00%	2.00%	2.00%

2024.09.19

公債交易

昨日台債指標五年券持續下探至 1.3902%，較前一日成交下滑 0.48bps，市場維持樂觀氣氛，但因美國及本地央行開會在即，整體交投清淡。

國外方面，FOMC 以 11:1 的投票結果宣布下調聯邦資金利率 2 碼至 4.75~5% 的區間，點陣圖顯示今年年底前還會降息兩碼，而明年將降息四碼。主席鮑爾表示有信心在政策適當的調整下可避免失業率如過去抗通膨時上升，他也強調這次升息兩碼並非未來降息的新步調，會後美債走軟，十年期美債上揚 5.82bps 收在 3.7038%。

附：收盤行情表 (last bid)

年期	指標券種	9月16日	9月18日	漲跌(b.p.)
2年	A13101	1.3200	1.3200	+0.00
5年	A13108	1.3950	1.3902	-0.48
10年	A13107	1.4600	1.4600	+0.00
20年	A13109	-	-	+0.00
30年	A13106	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