

2024.09.20

短期利率

昨日央行 NCD 到期 1,218.80 億元，發行存單 7 天、28 天期 NCD 共 1,840.80 億元，截至昨日為止央行 NCD 未到期餘額為 75,652.80 億元。

昨日雖有中油公司債交割的緊縮因子，但在市場資金充足下，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 3,660.30 億元。週四央行理監事會議的結果，如市場預期維持重貼現率不變，但調升存準率 1 碼，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

113/09/20	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%

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

2024.09.20

公債交易

昨日台債市場指標券均無成交，靜候台灣央行理監事會議的決策以及今日的 20 年券標售。下午央行如預期宣布維持重貼現率不變，但再度調升存準率 1 碼，並祭出第 7 波選擇性信用管制措施，總裁楊金龍表示此舉為抑制房市投機與囤房行為，不要讓市場有房價會一直上去的預期，並表示在房地產仍有緊縮的空間。

國外方面，美國最新初領失業救濟金人數報 21.9 萬人，低於預期的 23 萬人，為 5 個月以來新低。市場持續消化 FED 此次貨幣政策決議，美債長短天期利率漲跌互現，終場十年期美債小幅上揚 0.93bps 收在 3.7131%。

附：收盤行情表 (last bid)

年期	指標券種	9 月 18 日	9 月 19 日	漲跌(b. p.)
2 年	A13101	1.3200	1.3200	+0.00
5 年	A13108	1.3950	1.3902	+0.00
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