

2024.07.11

短期利率

昨日央行 NCD 到期 3,077.40 億元，發行存單 7 天、28 天期 NCD 共 2,904.90 億元，截至昨日為止央行 NCD 未到期餘額為 75,665.40 億元。

昨日市場資金依舊緊俏，雖央行降低沖銷力道惟市場資金需求上升亦墊高成本。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 4,615.30 億元。今日操作仍偏保守，短期利率高位靠攏。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

113/07/11	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

2024.07.11

公債交易

昨日台債市場十年期 R 券小幅上揚 0.25bps 至 1.755%，目前市場氣氛仍然偏空，各方關注今日五年期 R 券的得標結果，此次為調升存準率後的首次標售，路透調查中值落在 1.66-1.69% 之間，銀行的態度將是本次利率落點的關鍵。

國外方面，FED 主席鮑爾第二天赴國會聽證時釋出鴿派訊息，表示雖需要更多數據證明通膨緩和，但不需要等到通膨降至 2% 才開始降息，另外也表示美國勞動市場已經相當明顯地降溫，言論強化了市場對後續降息的預期，終場十年期美債下滑 1.18bps 收在 4.2841%。

附：收盤行情表 (last bid)

年期	指標券種	7月9日	7月10日	漲跌(b. p.)
2年	A13101	1.3100	1.3100	+0.00
5年	A13105R	1.6800	1.6800	+0.00
10年	A13107R	1.7525	1.7550	+0.25
20年	A13109	-	-	+0.00
30年	A13106	1.9750	1.9750	+0.00