

2024.07.18

## 短期利率

昨日央行 NCD 到期 3,123.50 億元，發行存單 7 天、28 天及 182 天期 NCD 共 3,317.50 億元，截至昨日為止央行 NCD 未到期餘額為 75,109.40 億元。

昨日銀行端及投信端的資金供給充沛，整體貨幣市場仍然維持寬鬆的格局，短期利率持穩在區間內。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 3,753.10 億元，另有二年期 NCD 發行 250.0 億元的緊縮因子。今日雖有 NCD 交割的緊縮因子，但因市場資金充裕，預計影響有限，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

113/07/18	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%

2024.07.18

## 公債交易

週三在持券信心穩定下，投資人進場補券，帶動殖利率曲線向下移動，在五年期券下跌到 1.57% 之際，十年增額券同步下滑到 1.68%。

國外方面，美國 20 年國債標售結果優於預期，儘管早盤因新屋開工戶數回升使國債下跌，不過在科技股遭到拋售下資金湧入避險性資產，終場十年期公債殖利率下跌 0.2 bps 至 4.1556%。

## 附：收盤行情表 (last bid)

年期	指標券種	7 月 16 日	7 月 17 日	漲跌(b. p.)
2 年	A13101	1.3100	1.3100	+0.00
5 年	A13105	1.5950	1.5700	-2.50
10 年	A13107R	1.7550	1.6800	-7.50
20 年	A13109	-	-	+0.00
30 年	A13106	1.9750	1.9750	+0.00