

2024.07.17

## 短期利率

昨日央行 NCD 到期 3,710.00 億元，發行存單 7 天、28 天期 NCD 共 3,620.00 億元，截至昨日為止央行 NCD 未到期餘額為 74,915.40 億元。

昨日雖有公債交割的緊縮因子，但因為市場資金充裕，因此並未受到影響，短期利率成交在區間內。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 3,123.50 億元。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，短期利率將持穩在區間內。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

113/07/17	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

2024.07.17

## 公債交易

週二受到近期美債走強的影響，台債信心回升，盤面五年券殖利率下跌 2 bps 至 1.595%。

國外方面，美國 6 月零售銷售月增持平，優於原先預期的-0.3%，且五月數值也從 0.1% 上修至 0.3%，消費支出穩健，數據公布後美債短暫下跌，不過午盤後逆勢收復早盤跌幅，終場十年期公債殖利率下跌 6.6 bps 至 4.1634%。

## 附：收盤行情表 (last bid)

年期	指標券種	7 月 15 日	7 月 16 日	漲跌(b. p.)
2 年	A13101	1.3100	1.3100	+0.00
5 年	A13105	1.6150	1.5950	-2.00
10 年	A13107R	1.7550	1.7550	+0.00
20 年	A13109	-	-	+0.00
30 年	A13106	1.9750	1.9750	+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