

2024.07.26

短期利率

昨日央行 NCD 到期 1,951.50 億元，發行存單 7 天、28 天期 NCD 共 1,988.50 億元，截至昨日為止央行 NCD 未到期餘額為 74,390.60 億元。

昨日雖有公司債交割的緊縮因子，但金額不大，因此未受到影響，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 5,930.00 億元。因休二天颱風假，今日市場一定大亂，以平帳為優先，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

113/07/26	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

2024.07.26

公債交易

台債市場因遇颱風休市兩日。

國外方面，因全球股市疲軟，債市湧入避險需求，但昨日公布美國第二季 GDP 季增年率初值 2.8%，增速遠高於第一季的 1.4%，也高於市場預期的 2%，數據出爐後美債的漲勢收斂，終場十年期美債下跌 4.31bps 收在 4.2407%。

附：收盤行情表 (last bid)

年期	指標券種	7月22日	7月23日	漲跌(b. p.)
2年	A13101	1.3100	1.3100	+0.00
5年	A13105	1.5400	1.5400	+0.00
10年	A13107R	1.6600	1.6600	+0.00
20年	A13109	-	-	+0.00
30年	A13106	1.9050	1.9050	+0.00