

2024.07.03

短期利率

昨日央行 NCD 到期 2,481.00 億元，央行發行存單 7 天、28 天期 NCD 共 1,452.00 億元，截至昨日為止央行 NCD 未到期餘額為 75,028.30 億元。

昨日，整體市場資金相當充裕，到期大都能續做，但利率變化不大，短期利率仍是成交在區間內。公債 RP 利率主要成交在 1.1-1.2%，公司債 RP 利率成交在 1.44%-1.54%。

今日有央行 NCD 到期 1,170.50 億元。目前市場資金仍然維持穩定偏寬鬆的狀態，因此短期利率仍將成交在區間內。預估本日公債 RP 利率成交在 1.1%-1.2%，公司債 RP 成交在 1.44%-1.54%。

附：債券附條件交易牌告利率

113/07/03	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

2024.07.03

公債交易

週二央行總裁在立法院質詢時被問到是否跟進美國降息，表示台灣跟國外情況不同，會看國際以及自身的情況再來做決定，市場預期目前利率水準將會在此維持一段時間，終場指標五年券上漲 0.5 bps 至 1.655%。

國外方面，美國五月職位空缺數升至 814 萬個高於市場預期，鮑威爾表示通膨正在回到下行軌道，希望在降息前能看到更多的證據，不過若是勞動力市場意外疲軟，也會使聯準會做出反應，終場十年期公債殖利率下跌 2.4 bps 至 4.4375%。

附：收盤行情表 (last bid)

年期	指標券種	7月1日	7月2日	漲跌(b. p.)
2年	A13101	1.3100	1.3100	+0.00
5年	A13105R	1.6500	1.6550	+0.50
10年	A13107R	-	-	+0.00
20年	A13109	-	-	+0.00
30年	A13106	2.0010	2.0010	+0.00