

2024.04.26

## 短期利率

昨日央行 NCD 到期 3,585.50 億元，央行發行存單 7 天、28 天期共 3,579.50 億元，截至昨日為止央行 NCD 未到期餘額為 77,463.05 億元。

昨日資金整體寬裕，利率大致不變。公債 RP 利率主要成交在 1.07-1.15%，公司債 RP 利率成交在 1.40%-1.50%。

今日有央行 NCD 到期 2,875.50 億元及公司債交割 121.00 億元。投信端的月底贖回效應浮現但利率將持穩。預估本日公債 RP 利率成交在 1.07%-1.15%，公司債 RP 成交在 1.40%-1.50%。

### 附：債券附條件交易牌告利率

113/04/26	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

2024.04.26

## 公債交易

週四市場等待美國第一季 GDP 和核心 PCE 等重要數據，盤面上交投冷清，僅 2 年券成交一檔在 1.375%，五、十年期指標券皆未成交。

國外方面，第一季美國 GDP 年增 1.6%，遠低於市場預期，然而核心 PCE 物價指數年增 3.7%，顯示通膨最後一哩路仍頑強，數據公布後公債殖利率上漲，十年期公債一度突破 4.7%，利率期貨顯示目前市場訂價今年僅有降息一碼的空間，終場十年期公債殖利率上漲 5.8 b.p. 至 4.6998%。

### 附：收盤行情表 (last bid)

年期	指標券種	4 月 24 日	4 月 25 日	漲跌(b. p.)
2 年	A13101	1.4500	1.3750	-7.50
5 年	A13105	1.5860	1.5860	+0.00
10 年	A13107	1.6680	1.6680	+0.00
20 年	A13102	1.8100	1.8100	+0.00
30 年	A12111	1.7500	1.7500	+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