

2024.05.03

短期利率

昨日央行 NCD 到期 4,066.50 億元，央行發行存單 7 天、28 天期 NCD 共 3,287.50 億元，截至昨日為止央行 NCD 未到期餘額為 77,045.85 億元。

昨日貨幣市場短期資金供應充沛，加上無大型的緊縮因素影響，短期利率仍將成交在區間內。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 915.00 億元。目前市場資金供需仍屬平穩，預料短期利率走勢變化不大，仍將走穩在區間內。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

113/05/03	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

2024.05.03

公債交易

昨日台債市場指標券均無成交，市場交投意願持續低迷，十年期冷券成交在 1.71% 附近，並未脫離之前的水準，美債利率回落也難以提振台灣利率走勢，市場等待本月十年期乙券及三十年券的標售結果。

國外方面，最新美國初領失業救濟金人數 20.8 萬人，持平於前週的修正值，優於經濟學家預期的 21.1 萬人。FOMC 會後淡化市場對 FED 轉向升息的擔憂，美債利率維持漲勢，十年期美債終場下滑 4.72bps 收在 4.5811%。

附：收盤行情表 (last bid)

年期	指標券種	4 月 30 日	5 月 2 日	漲跌(b. p.)
2 年	A13101	1.3750	1.3750	+0.00
5 年	A13105	1.5900	1.5900	+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