

2024.07.05

短期利率

昨日央行 NCD 到期 2,809.10 億元，央行發行存單 7 天、28 天及 364 天期 NCD 共 3,892.30 億元，截至昨日為止央行 NCD 未到期餘額為 76,371.00 億元。

昨日，雖有 364 天期 NCD 交割的緊縮因子，但因市場資金寬鬆，並未受到太大的影響，短期利率仍是成交在區間內。公債 RP 利率主要成交在 1.1-1.12%，公司債 RP 利率成交在 1.44%-1.54%。

今日有央行 NCD 到期 2,450.00 億元。市場資金穩偏多，投信和壽險資金均屬充裕，利率無太大變化，預期短期利率將成交在區間內。預估本日公債 RP 利率成交在 1.1%-1.12%，公司債 RP 成交在 1.44%-1.54%。

附：債券附條件交易牌告利率

113/07/05	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

2024.07.05

公債交易

昨日各方等待今日台灣 CPI 數據，盤面交投冷清，指標公債沒有成交。

國外方面，美國週四獨立紀念日休市一天。

附：收盤行情表 (last bid)

年期	指標券種	7月3日	7月4日	漲跌(b. p.)
2年	A13101	1.3100	1.3100	+0.00
5年	A13105R	1.6700	1.6700	+0.00
10年	A13107R	1.7525	1.7525	+0.00
20年	A13109	-	-	+0.00
30年	A13106	2.0010	1.9750	-2.60

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