

2024.07.10

短期利率

昨日央行 NCD 到期 5,232.90 億元，發行存單 7 天、28 天期 NCD 共 4,268.00 億元，截至昨日為止央行 NCD 未到期餘額為 75,837.90 億元。

昨日市場資金分配不均，銀行在調整積數同時對上市公司將發放的現金股利等變數提前準備，態度傾向謹慎。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 3,077.40 億元。延續昨日保守操作，短期利率有機會往區間上緣靠近。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

113/07/10	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

2024.07.10

公債交易

昨日台債市場五年期 R 券利率繼續上探至 1.68%，較前一日上揚 1bp，央行調升存準率加上進入股利發放旺季，市場資金開始趨緊使短率承壓，3M TAIBOR 持續緩步上移至 1.633%。

國外方面，FED 主席鮑爾在出席國會聽證會時強調，正在尋找更多良好的數據來增強 FED 認為通膨在往 2% 目標前進的信心，整體談話不如市場預期的鴿派，美債利率自低點反彈，終場十年期走升 1.76bps 收在 4.2959%。

附：收盤行情表 (last bid)

年期	指標券種	7月8日	7月9日	漲跌(b. p.)
2年	A13101	1.3100	1.3100	+0.00
5年	A13105R	1.6700	1.6800	+1.00
10年	A13107R	1.7525	1.7525	+0.00
20年	A13109	-	-	+0.00
30年	A13106	1.9750	1.9750	+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