

2024.07.04

## 短期利率

昨日央行 NCD 到期 1,170.50 億元，央行發行存單 7 天、28 天期 NCD 共 1,430.00 億元，截至昨日為止央行 NCD 未到期餘額為 75,287.80 億元。

昨日，市場資金充沛，從投信，壽險到銀行均多錢，到期都能續做，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 2,809.10 億元，另有 364 天期 NCD 交割 1,400 億元。近來市場資金寬鬆狀況仍舊持續，銀行及投信等資金供給者找券需求仍在，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

113/07/04	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

2024.07.04

## 公債交易

週三市場空方氣焰不減，在五年券發行前交易彈到波段新高後十年券也跟進向上成交到 1.7525%。

國外方面，美國 6 月 ISM 非製造業指數跌至 48.8，遠低於市場預期，其中商業活動生產指數落入榮枯線下，數據強化市場的降息預期，終場美國十年期公債直利率下跌 7.3 bps 至 4.3587%。

### 附：收盤行情表 (last bid)

年期	指標券種	7月2日	7月3日	漲跌(b. p.)
2年	A13101	1.3100	1.3100	+0.00
5年	A13105R	1.6550	1.6700	+1.50
10年	A13107R	-	1.7525	+0.00
20年	A13109	-	-	+0.00
30年	A13106	2.0010	2.0010	+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