

2024.07.09

短期利率

昨日央行 NCD 到期 306.70 億元，央行發行存單 7 天、28 天期 NCD 共 915.00 億元，截至昨日為止央行 NCD 未到期餘額為 76,802.80 億元。

昨日央行存單到期量不大，銀行拆款利率略有調高，加上周四台積電股利發放，銀行操作保守，短期利率仍成交在區間內。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 5,232.90 億元。市場資金分布不均現象仍在，持續關注存準上調效應，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 1.10%-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

113/07/09	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

2024.07.09

公債交易

雖然美債利率因非農就業數據帶動大幅下滑，但昨日台債並未跟進反應，因本地 6 月 CPI 數據高於預期，市場擔憂通膨將影響 9 月央行的貨幣政策決議，加上即將標售五年期 R 券，各方保守看待標售結果，五年期 R 券收平在 1.67%。

國外方面，昨日無重要數據公布，市場主要受法國選舉結果影響波動，投資人等待 FED 主席鮑爾連續兩天將出席國會聽證會，以及週四美國 6 月 CPI 的公布，終場十年期美債收在 4.2783%，與前日沒有太大變化。

附：收盤行情表 (last bid)

年期	指標券種	7月5日	7月8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	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