

2024.05.08

短期利率

昨日央行 NCD 到期 1,349.00 億元，央行發行存單 7 天、28 天期 NCD 共 1,379.50 億元，截至昨日為止央行 NCD 未到期餘額為 79,666.85 億元。

昨日進入新提存期，市場資金相當平穩，銀行端資金略為偏多，短期利率成交在區間內。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 1,143.50 億元。整體市場資金分配依舊多缺不一，但整體資金仍屬寬鬆，短期利率仍將成交在區間內。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

113/05/08	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

2024.05.08

公債交易

週二十年期乙券得標利率 1.68%，符合市場預期，得標比重銀行業 56.25%，證券業 43.75%。另一方面，台灣 4 月 CPI 年增 1.95% 低於市場預期，雖然有醫療費用及電費上漲等因素，但蛋類價格自去年高點回落抵銷部分漲幅，主計處預估五月通膨率有可能重回 2% 以上，台債市場昨日等待標債結果而交投清淡，盤面上僅一支 30 年券成交在 1.93%。

國外方面，週一美國三年期公債標售熱絡，非公債交易商得標比重升至 85.1%，中標殖利率較發行前交易低 0.3 個百分點，終場美國十年期公債殖利率下跌 2.6 b.p. 至 4.461%。

附：收盤行情表 (last bid)

年期	指標券種	5 月 6 日	5 月 7 日	漲跌(b. p.)
2 年	A13101	1.3750	1.3750	+0.00
5 年	A13105	1.5750	1.5750	+0.00
10 年	A13107	1.6750	1.6750	+0.00
20 年	A13102	1.8100	1.8100	+0.00
30 年	A13106	1.7500	1.9300	+18.00

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