

2024.07.16

短期利率

昨日央行 NCD 到期 3,412.00 億元，發行存單 7 天、28 天期 NCD 共 3,336.50 億元，截至昨日為止央行 NCD 未到期餘額為 75,005.40 億元。

昨日投信端多缺不一，來自法人的資金挹注不少，市場資金充足，短期利率成交在區間內。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 3,710.00 億元，另有公債 A13105R 交割 300 億元。雖有公債交割的緊縮因子，但因為市場資金充裕，預計影響有限，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

113/07/16	10 天	20 天	30 天	60 天	90 天
RP	0.60%	0.60%	0.60%	0.60%	0.60%
RS	2.00%	2.00%	2.00%	2.00%	2.00%

2024.07.16

公債交易

週一市場觀察川普槍擊對美國公債的影響，盤面交投清淡，僅指標五年券成交在 1.615%。

國外方面，川普在遭暗殺未遂後當選機率大幅提升，市場中”川普交易”逐漸盛行，使長端債券價格承壓，終場美國十年期公債殖利率上漲 4.3 bps 至 4.2255%。

附：收盤行情表 (last bid)

年期	指標券種	7月12日	7月15日	漲跌(b. p.)
2年	A13101	1.3100	1.3100	+0.00
5年	A13105R	1.6200	1.6150	-0.50
10年	A13107R	1.7550	1.7550	+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