

2024.07.23

短期利率

昨日央行 NCD 到期 3,206.50 億元，發行存單 7 天、28 天期 NCD 共 3,028.50 億元，截至昨日為止央行 NCD 未到期餘額為 74,353.60 億元。

昨日投信端資金多缺不一，但銀行及壽險端則資金充裕，短期利率仍是成交在區間內。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 1,951.50 億元，另有富邦金公司債發行 41.0 億元的緊縮因子。今日雖有公司債交割的緊縮因子，但金額不大，因此將不受到影響，短期利率仍將成交在區間內。預估本日公債 RP 利率成交在 1.10%-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

113/07/23	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%

2024.07.23

公債交易

台債市場在上週利率有比較大的回檔後趨於平靜，因台灣央行後續動作不明，加上美債利率自低點反彈，向下追價動力難以提升，昨日指標五年及十年券均無成交。

國外方面，週一美國無重要經濟數據公布，市場觀望美國總統拜登宣布退選後的影響，以及本週經濟數據的公布，美債利率小幅走升，十年期終場上揚 1.36bps 收在 4.2525%。

附：收盤行情表 (last bid)

年期	指標券種	7月19日	7月22日	漲跌(b. p.)
2年	A13101	1.3100	1.3100	+0.00
5年	A13105	1.5400	1.5400	+0.00
10年	A13107R	1.6600	1.6600	+0.00
20年	A13109	-	-	+0.00
30年	A13106	1.9050	1.9050	+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