

2024.07.02

## 短期利率

昨日央行 NCD 到期 2,612.00 億元，央行發行存單 7 天、28 天期 NCD 共 2,851.70 億元，截至昨日為止央行 NCD 未到期餘額為 76,057.30 億元。

昨日，排除了月底贖回的緊縮因素，月初投信基金有新的申購款回流，市場資金寬鬆，短期利率脫離高檔，但仍是成交在區間內。公債 RP 利率主要成交在 1.1-1.2%，公司債 RP 利率成交在 1.44%-1.54%。

今日有央行 NCD 到期 2,481.00 億元。時序回到月初，市場上也恢復以往寬鬆態勢，在整體貨幣市場緊縮因子偏少下，RP 利率也略往下帶，預期短期利率將往區間低檔靠攏。預估本日公債 RP 利率成交在 1.1%-1.2%，公司債 RP 成交在 1.44%-1.54%。

### 附：債券附條件交易牌告利率

113/07/02	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

2024.07.02

## 公債交易

週一盤面指標五年券在交易商持續看空下，殖利率再度向上走升 1.44 bps 至 1.65%。

國外方面，美國 6 月 ISM 製造業指數降至 48.5，低於市場預期，不過其中價格指數從前值 57 滑落至 52.1，通膨壓力趨緩，不過後續最高法院裁定部分支持川普的豁免權訴求，讓長債殖利率跳升，終場美國 10 年期公債殖利率上漲 7.9 bps 至 4.4752%。

## 附：收盤行情表 (last bid)

年期	指標券種	6 月 28 日	7 月 1 日	漲跌(b. p.)
2 年	A13101	1.3100	1.3100	+0.00
5 年	A13105R	1.6356	1.6500	+1.44
10 年	A13107R	-	-	+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