

2024.07.19

## 短期利率

昨日央行 NCD 到期 3,753.10 億元，發行存單 7 天、28 天及 2 年期 NCD 共 3,629.30 億元，截至昨日為止央行 NCD 未到期餘額為 74,985.60 億元。

昨日雖有 NCD 交割的緊縮因子，但因市場資金充裕，因此未受到影響，短期利率仍將成交在區間內。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 3,127.50 億元，另有台電公司債發行 100.5 億元的緊縮因子。今日雖有公司債交割的緊縮因子，但因市場資金充足，預計影響有限，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

113/07/19	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%

2024.07.19

## 公債交易

週四在投資人補券需求持續下，十年券與十年期增額券利率同步下行，十年券收在 1.65%，同期增額券則是收在 1.66%。

國外方面，美國上週初領失業救濟金增至 24.3 萬人，高於市場預期，使盤中殖利率走低，不過後續 10 年期抗通膨債券標售利率高於市場預期令債市走弱，終場十年期公債殖利率上漲 4.5 bps 至 4.2021%。

## 附：收盤行情表 (last bid)

年期	指標券種	7月17日	7月18日	漲跌(b. p.)
2年	A13101	1.3100	1.3100	+0.00
5年	A13105	1.5700	1.5700	-0.00
10年	A13107R	1.6800	1.6600	-2.00
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