

2024.04.30

短期利率

昨日央行 NCD 到期 3,441.00 億元，央行發行存單 7 天、28 天期 NCD 共 3,591.00 億元，截至昨日為止央行 NCD 未到期餘額為 77,744.05 億元。

昨日月底例行性資金需求浮現，部份投信出現較大的贖回，市場資金分配略有不均，但因整體市場資金寬鬆，附買回利率依舊成交在區間內。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 2,064.20 億元。今日月底最後一天交易日，仍將面臨一些例行性資金需求，但因整體市場資金充足，因此預計影響有限，預料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

113/04/30	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

2024.04.30

公債交易

昨日台債市場交投持續清淡，目前市場沒有太多的方向指引，等殖盤面僅成交指標五年券 1.5E 在 1.59%，較前次微揚 0.4bps，關注本週 FOMC 會議結果。

國外方面，德國 4 月份 CPI 年增 2.2%，略低於市場預期的 2.3%，主要受益於服務業通膨的放緩，數據公布後歐債上漲也推動美債走高，終場十年期美債收在 4.6115%，較前一日下行 5.75bps。

附：收盤行情表 (last bid)

年期	指標券種	4 月 26 日	4 月 29 日	漲跌(b. p.)
2 年	A13101	1.3750	1.3750	+0.00
5 年	A13105	1.5860	1.5900	+0.40
10 年	A13107	1.6680	1.6680	+0.00
20 年	A13102	1.8100	1.8100	+0.00
30 年	A12111	1.7500	1.7500	+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