

2024.05.02

短期利率

昨日央行 NCD 到期 2,064.20 億元，央行發行存單 7 天、28 天期 NCD 共 2,145.00 億元，截至昨日為止央行 NCD 未到期餘額為 77,824.85 億元。

昨日月底最後一天交易日，仍是面臨一些例行性資金需求，但因整體市場資金充足，因此並未受到太大影響，短期利率仍是成交在區間內。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 4,066.50 億元。由於目前貨幣市場短期資金供應充沛，加上今日無大型的緊縮因素影響，預料短期利率走勢仍走穩在近期區間內。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

113/05/02	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

2024.05.02

公債交易

週二台債市場指標五年及十年券均無成交，雖然美債利率自高點回落，但台債並未跟進反應，因目前市場信心仍然薄弱，待 FOMC 會後給出更多的方向指引。

國外方面，FOMC 會議如預期宣布維持聯邦基金利率在 5.25-5.5% 不變，聲明中指出讓通膨回落至 2% 的目標缺乏進一步進展，不過另一方面，將放緩縮表速度，把每月減持 600 億美元公債的上限，降至 250 億美元，主席鮑爾也表示下一步不太可能是升息，緩解市場之前對 FED 鷹派轉向的擔憂，提振美債走勢，終場十年期美債下行 5.15bps 收在 4.6283%。

附：收盤行情表 (last bid)

年期	指標券種	4 月 29 日	4 月 30 日	漲跌(b. p.)
2 年	A13101	1.3750	1.3750	+0.00
5 年	A13105	1.5900	1.5900	+0.00
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