

2024.05.09

短期利率

昨日央行 NCD 到期 1,143.50 億元，央行發行存單 7 天、28 天及 182 天期 NCD 共 1,234.50 億元，截至昨日為止央行 NCD 未到期餘額為 79,757.85 億元。

昨日貨幣市場多缺不一，雖然有部分贖回的狀況發生，不過在市場上找錢也不會太難，整體資金還是偏多的，RP 利率成交在區間內。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 4,861.70 億元。投信端資金依舊多缺不一，整體市場呈現穩中偏多格局，預料 RP 利率持穩於區間內。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

113/05/09	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

2024.05.09

公債交易

台灣 4 月出口年增 4.3%，增長不如預期，雖然 AI 需求維持強勁但消費性電子復甦不如預期，不過財政部仍預估 5 月出口仍能維持正成長。週三台債市場長短端走勢分歧，受到 CPI 低於預期的利多因素下，短天期券種買盤追價積極，指標 5 年券下跌 3 b.p. 至 1.545%，十年券下跌 1 b.p. 至 1.665%，不過市場仍有部分擔憂未來通膨走升的因素，使 30 年指標券上漲 1 b.p. 至 1.94%。

國外方面，大量的公司債發行吸走市場流動性，令美國十年期公債中標殖利率高於發行前交易 1 b.p.，開標後長短天期殖利率同步走升，終場十年期公債殖利率上漲 3.7 b.p. 至 4.4937%。

附：收盤行情表 (last bid)

年期	指標券種	5 月 7 日	5 月 8 日	漲跌(b. p.)
2 年	A13101	1.3750	1.3750	+0.00
5 年	A13105	1.5750	1.5450	-3.00
10 年	A13107	1.6750	1.6650	-1.00
20 年	A13102	1.8100	1.8100	+0.00
30 年	A13106	1.9300	1.9400	+1.00

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