

2024.05.10

短期利率

昨日央行 NCD 到期 4,861.70 億元，央行發行存單 7 天、28 天期 NCD 共 4,157.10 億元，截至昨日為止央行 NCD 未到期餘額為 79,053.25 億元。

昨日從投信、壽險到銀行到期大都能續作，整體市場資金呈現平穩，短期利率變化不大，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 3,591.00 億元，另有公債 A13202 期交割 80 億元。今日雖有公債交割的緊縮因子，但因整體市場資金寬鬆，因此預計影響有限，預料短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

113/05/10	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

2024.05.10

公債交易

週四台債市場在 CPI 數據的激勵後交投恢復冷清，盤面上未成交。

國外方面，上週初領失業救濟金人數升至 23.1 萬人，高於預期的 21 萬。且 30 年公債中標殖利率低於發行前交易 0.7 b.p.，推動公債走高，終場美國十年期公債殖利率下跌 4.1 b.p.至 4.4531%。

附：收盤行情表 (last bid)

年期	指標券種	5 月 8 日	5 月 9 日	漲跌(b. p.)
2 年	A13101	1.3750	1.3750	+0.00
5 年	A13105	1.5450	1.5450	+0.00
10 年	A13107	1.6650	1.6650	+0.00
20 年	A13102	1.8100	1.8100	+0.00
30 年	A13106	1.9400	1.9400	+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