

2024.05.07

短期利率

昨日央行 NCD 到期 2,855.00 億元，央行發行存單 7 天、28 天及 364 天期 NCD 共 4,381.50 億元，截至昨日為止央行 NCD 未到期餘額為 79,636.35 億元。

昨日市場資金分配略顯分配不均，但整體資金供需仍屬充裕，短期利率走勢變化不大，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 1,349.00 億元。進入提存期初，市場資金相當平穩，銀行端資金略為偏多，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

113/05/07	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%

2024.05.07

公債交易

週一台債市場受到國際債市走多的影響下，5年期公債殖利率向下成交到 1.575%，而十年期殖利率因等待今日乙券標售結果而交投冷清。

國外方面，聯準會官員威廉斯表示，目前貨幣政策處在良好位置，但最終聯準會仍將降息，並預估今年美國 GDP 成長將落在 2%-2.5% 之間，終場美國十年期公債殖利率下跌 1.8 b.p. 至 4.4894%。

附：收盤行情表 (last bid)

年期	指標券種	5月3日	5月6日	漲跌(b.p.)
2年	A13101	1.3750	1.3750	+0.00
5年	A13105	1.5800	1.5750	-0.50
10年	A13107	1.6750	1.6750	+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