

2024.06.19

## 短期利率

昨日央行 NCD 到期 3,805.00 億元，央行發行存單 7 天、28 天期 NCD 共 3,737.00 億元，截至昨日為止央行 NCD 未到期餘額為 73,085.70 億元。

昨日雖有公司債交割的緊縮因子，但在市場資金充裕下，並未受到太大影響，短期利率成交在區間內。公債 RP 利率主要成交在 1.1-1.2%，公司債 RP 利率成交在 1.44%-1.54%。

今日有央行 NCD 到期 3,015.50 億元。無特殊緊縮因子，市場有些短錢充斥，呈現穩中偏鬆的態勢，預期短期利率將成交在區間內。預估本日公債 RP 利率成交在 1.1%-1.2%，公司債 RP 成交在 1.44%-1.54%。

### 附：債券附條件交易牌告利率

113/06/19	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

2024.06.19

## 公債交易

週二十年券得標利率 1.675%，落於市場預測區間上緣。得標比重銀行業 83.43%、證券業 16.57%，投標倍數 1.41，開標後盤面向下追價一支到 1.666%。

國外方面，五月美國零售銷售月增 0.1% 低於市場預期，主因汽油價格下跌，再加上二十年期國債中標值利率低於發行前交易 2.8 bps 提振債市信心，終場美國十年期公債值利率下跌 6.2 bps 至 4.2188%。

## 附：收盤行情表 (last bid)

年期	指標券種	6 月 17 日	6 月 18 日	漲跌(b. p.)
2 年	A13101	1.3100	1.3100	+0.00
5 年	A13105	1.5400	1.5400	+0.00
10 年	A13107	1.6100	1.6660	+5.60
20 年	A13102	1.8100	1.8100	+0.00
30 年	A13106	1.9600	1.9600	+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