

2024.06.12

## 短期利率

昨日央行 NCD 到期 7,836.85 億元，央行發行存單 7 天、28 天期 NCD 共 5,387.90 億元，截至昨日為止央行 NCD 未到期餘額為 73,636.70 億元。

昨日因應信用卡稅款上繳國庫，銀行端都已作好準備，投信端資金則是多缺不一，整體市場資金供應尚稱充足，短期利率成交在區間內。公債 RP 利率主要成交在 1.09-1.15%，公司債 RP 利率成交在 1.42%-1.50%。

今日有央行 NCD 到期 3,146.20 億元，另有富邦人壽次債交割 250 億元。市場等待週四央行理監事會議開會結果，市場短錢充斥，因此雖有公司債交割的緊縮因子，但預計影響有限，預期短期利率仍將成交在區間內。預估本日公債 RP 利率成交在 1.09%-1.15%，公司債 RP 成交在 1.42%-1.50%。

### 附：債券附條件交易牌告利率

113/06/12	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

2024.06.12

## 公債交易

昨日台債市場交投冷清，因本週將有 FOMC 及央行理監事會議的召開，各方仍維持保守觀望，在非農就業數據公布後美債利率有比較大幅的回彈，指標十年券也跟進上彈 1.5bps 收在 1.61%。

國外方面，十年期美債拍賣需求強勁，提振整條曲線走勢，投資人觀望今日 CPI 數據的公布及 FOMC 的會議結果，終場十年期美債下滑 6.3bps 收在 4.404%。

## 附：收盤行情表 (last bid)

年期	指標券種	6月7日	6月11日	漲跌(b. p.)
2年	A13101	1.3100	1.3100	+0.00
5年	A13105	1.4710	1.4710	+0.00
10年	A13107	1.5950	1.6100	+1.50
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