

2024.06.28

## 短期利率

昨日央行 NCD 到期 1,660.50 億元，央行發行存單 7 天、28 天期 NCD 共 2,244.50 億元，截至昨日為止央行 NCD 未到期餘額為 75,102.10 億元。

昨日，因臨近月底，有些例行性資金需求顯現，加上還有多檔債券交割，短期利率仍是成交在區間高檔。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 1,221.00 億元，另南山人壽次債交割共 40.40 億元。今日為月底最後一天交易，仍然會有些例行性資金需求出現，加上還有債券交割，預期短期利率仍持續成交在區間高檔。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

113/06/28	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

2024.06.28

## 公債交易

昨日在美債利率上彈的帶動下，台債五年期 R 券小幅上行 0.5bps 收在 1.625%，市場除了對後續台灣央行政策的擔憂外，也等待今日美國 PCE 數據是否影響未來的降息前景，各方操作保守，整體交投維持清淡。

國外方面，美國第一季 GDP 季增年率終值小幅自 1.3% 上調至 1.4%，不過較去年第四季 3.4% 大幅放緩；最新初領失業救濟金人數 23.3 萬人，較前周下滑 6,000 人。另一方面，七年期美國公債獲得強勁需求，終場十年期利率下滑 4.3bps 收在 4.2864%。

### 附：收盤行情表 (last bid)

年期	指標券種	6 月 26 日	6 月 27 日	漲跌(b. p.)
2 年	A13101	1.3100	1.3100	+0.00
5 年	A13105R	1.6200	1.6250	+0.50
10 年	A13107R	-	-	+0.00
20 年	A13109	-	-	+0.00
30 年	A13106	2.0010	2.0010	+0.00