

2024.06.04

短期利率

昨日央行 NCD 到期 4,211.50 億元，央行發行存單 7 天、28 天期 NCD 共 3,071.00 億元，截至昨日為止央行 NCD 未到期餘額為 76,511.65 億元。

昨日月初整體市場恢復寬鬆的態勢，短期利率脫離區間的高檔，但仍是成交在區間內。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 1,395.50 億元，另有 364 天期 NCD 發行 1,400 億元。今日雖有 364 天期 NCD 交割的緊縮因子，但市場資金寬鬆下，預計影響有限，預期短期利率仍是成交在區間內。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

113/06/04	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

2024.06.04

公債交易

台灣 5 月製造業 PMI 升至 55.4，創 2022 年 5 月以來新高。週一市場等待本週 CPI 數據給出更多指引，盤面指標十年期公債成交一支在 1.61%。

國外方面，美國 ISM 製造業 PMI 指數降至 48.7，低於市場預期，其中新訂單指數從前值 49.1 下滑至 45.4，創 2022 年 6 月以來最大降幅，價格指數由 60.9 下滑至 57，通膨壓力減低，終場美國十年期公債殖利率下跌 9.3 bps 至 4.406%。

附：收盤行情表 (last bid)

年期	指標券種	5 月 31 日	6 月 3 日	漲跌(b. p.)
2 年	A13101	1.3100	1.3100	+0.00
5 年	A13105	1.4748	1.4748	+0.00
10 年	A13107	1.6100	1.6100	+0.00
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