

2024.05.30

短期利率

昨日央行 NCD 到期 541.00 億元，央行發行存單 7 天、28 天期 NCD 共 1,094.20 億元，截至昨日為止央行 NCD 未到期餘額為 78,591.15 億元。

昨日投信端月底基金贖回壓力仍在，而銀行、壽險端資金供給尚稱平穩，但就是議價空間不大，讓 RP 利率持續高檔整理。公債 RP 利率主要成交在 1.09-1.15%，公司債 RP 利率成交在 1.40%-1.50%。

今日有央行 NCD 到期 2,433.50 億元。月底最後二天交易日，投信端仍將面臨較大贖回壓力，市場依舊保守應對，預期短期利率仍將成交在區間高檔。預估本日公債 RP 利率成交在 1.09%-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

113/05/30	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

2024.05.30

公債交易

雖然美債受經濟強於預期影響走弱，但台債在籌碼的保護下仍維持成交於平盤，指標十年、三十年券分別收在 1.61% 及 1.96%，整體而言月底各方保守操作，盡量讓利率持穩於區間之內。

國外方面，德國 5 月消費者物價指數年增自前值 2.4% 攀升至 2.8%，高於市場預期的 2.7%，刺激歐債走跌，加上之後 7 年期美債標售結果仍然疲軟，均帶動美債跌勢擴大，終場十年期美債上行 6.17bps 收在 4.6117%。

附：收盤行情表 (last bid)

年期	指標券種	5 月 28 日	5 月 29 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