

2024.06.05

## 短期利率

昨日央行 NCD 到期 1,395.50 億元，央行發行存單 7 天、28 天及 364 天期 NCD 共 2,781.00 億元，截至昨日為止央行 NCD 未到期餘額為 77,897.15 億元。

昨日雖有 364 天期 NCD 交割的緊縮因子，但在市場資金充裕下，因此並未受到影響，短期利率仍是成交在區間內。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 1,488.50 億元。月初因有稅款繳庫等多項變數影響，使得市場資金供應不如預期，短期利率波動不大，預期仍是成交在區間內。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

113/06/05	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

2024.06.05

## 公債交易

週二市場交投清淡，月初市場持續有補券需求，盤面十年期公債成交兩支在 1.61%。

國外方面，美國 4 月 JOLTS 職位空缺數降至 805.9 萬個，創 2021 年 2 月以來新低，數據顯示就業市場逐漸走軟，帶動國債走高，終場美國十年期公債殖利率下跌 5.9 bps 至 4.3298%。

### 附：收盤行情表 (last bid)

年期	指標券種	6 月 3 日	6 月 4 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