

2024.06.13

短期利率

昨日央行 NCD 到期 3,146.20 億元，央行發行存單 7 天、28 天期 NCD 共 3,121.40 億元，截至昨日為止央行 NCD 未到期餘額為 73,611.90 億元。

昨日雖有富邦人壽次債交割 250 億的緊縮因子，市場等待週四央行理監事會議開會結果，因此市場短錢充斥，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 4,875.80 億元。無特殊的緊縮因子，市場等待央行理監事會議開會結果，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

| 113/06/13 | 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

2024.06.13

公債交易

昨日台債市場交投意願持續低迷，指標券均無成交，冷券市場也乏人問津，市場觀望美國 CPI 數據公布及 FOMC 的會議結果。

國外方面，美國 5 月 CPI 年增 3.4%，低於前值 3.6% 及預期的 3.5%，為三年來新低，通膨持續回落提振市場的降息預期，美債利率大幅回落，不過之後的 FOMC 會議上，FED 宣布維持基準利率不變，但對 2024 年的降息預期僅一碼，並上調了對通膨的預估—2024 年至 2.8%、2025 年至 2.3%，會後美債利率收斂跌幅，終場十年期下滑 8.8bps 收在 4.316%。

附：收盤行情表 (last bid)

| 年期 | 指標券種 | 6 月 11 日 | 6 月 12 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 | 1.6100 | 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