

2024.05.23

短期利率

昨日央行 NCD 到期 2,857.50 億元，央行發行存單 7 天、28 天及 182 天期 NCD 共 3,368.50 億元，截至昨日為止央行 NCD 未到期餘額為 78,640.95 億元。

昨日資金缺口不大，成交以到期續作為主，RP 利率大多成交在舊有區間內。公債 RP 利率主要成交在 1.07-1.15%，公司債 RP 利率成交在 1.40%-1.50%。

今日有央行 NCD 到期 3,613.00 億元。無特殊的緊縮因子，市場短錢充斥，整體市場資金情勢變化不大，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 1.07%-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

113/05/23	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

2024.05.23

公債交易

30 年券標售後長端曲線定錨，雖略高於市場預期不過並未突破 2% 大關使曲線沒有上移的空間，而在近期無重大事件引導下，盤面交投清淡，五年券上升 0.3 bps 至 1.463%，十年券下跌 1 bps 至 1.6%。

國外方面，聯準會會議紀要顯示許多官員質疑目前利率水準是否能夠降低通膨至目標水平，且表達若有必要將支持升息，終場十年期美債殖利率上漲 1.8 bps 至 4.4296%。

附：收盤行情表 (last bid)

年期	指標券種	5 月 21 日	5 月 22 日	漲跌(b. p.)
2 年	A13101	1.3100	1.3100	+0.00
5 年	A13105	1.4600	1.4630	+0.30
10 年	A13107	1.6100	1.6000	-1.00
20 年	A13102	1.8100	1.8100	+0.00
30 年	A13106	1.9900	1.9900	+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