

2024.06.07

短期利率

昨日央行 NCD 到期 3,530.10 億元，央行發行存單 7 天、28 天期 NCD 共 2,763.10 億元，截至昨日為止央行 NCD 未到期餘額為 76,931.15 億元。

昨日由於台股表現強勢，投信股票型基金不斷解錢，使得在 RP 的資金供應呈現多缺不一，短期利率主要是成交在區間內。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 3,530.10 億元。下周要上繳信用卡款，並考量理監事會議變數，大家操作仍會比較保守因應，預期短期利率將朝利率區間高檔靠攏。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

113/06/07	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

2024.06.07

公債交易

央行行長週四赴立法院質詢時表示，台灣通膨逐步下降，且時常給予市場” Surprise” 也是不好，被解讀為第二季不升息而緩解債市壓力，十年期指標公債下跌 2bp 至 1.59%。

國外方面，美國上周初領失業救濟金人數升至 22.9 萬人，市場等待週五非農新增就業人數報告，債市波動較小，終場美國十年期公債殖利率上漲 0.6 bp 至 4.2812%。

附：收盤行情表 (last bid)

年期	指標券種	6月5日	6月6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	1.5900	-2.00
20年	A13102	1.8100	1.8100	+0.00
30年	A13106	1.9600	1.9600	+0.00