

2024.06.25

短期利率

昨日央行 NCD 到期 3,097.50 億元，央行發行存單 7 天、28 天期 NCD 共 3,152.50 億元，截至昨日為止央行 NCD 未到期餘額為 73,915.80 億元。

昨日有多檔債券交割，加上接近月底，有些例行性需求顯現，市場資金短缺，短期利率走高。公債 RP 利率主要成交在 1.1-1.2%，公司債 RP 利率成交在 1.44%-1.54%。

今日有央行 NCD 到期 1,929.00 億元。由於本週有多檔公司債及金融債交割，加上季報、半年報作帳等因素干擾，市場資金將不若先前寬裕，調度人員操作上相對保守，預期短期利率將成交在區間高檔。預估本日公債 RP 利率成交在 1.1%-1.2%，公司債 RP 成交在 1.44%-1.54%。

附：債券附條件交易牌告利率

113/06/25	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

2024.06.25

公債交易

昨日台債市場盤面均無成交，3M TAIBOR 利率繼續上調，市場擔憂月底資金情況使短率承壓，不過觀察冷券市場長端利率暫時持穩，預料整體交投將維持清淡。

國外方面，昨日美國無特殊經濟數據公布，市場交投清淡，目前 FED 官員們言論分歧，市場等待本週 PCE 的數據能給出更多方向指引，終場十年期美債下滑 2.29bps 收在 4.2341%。

附：收盤行情表 (last bid)

年期	指標券種	6月21日	6月24日	漲跌(b.p.)
2年	A13101	1.3100	1.3100	+0.00
5年	A13105	1.5500	1.5500	+0.00
10年	A13107	1.6950	1.6950	+0.00
20年	A13102	1.8100	1.8100	+0.00
30年	A13106	2.0200	2.0110	-0.90

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