

2024.06.14

短期利率

昨日央行 NCD 到期 4,875.80 億元，央行發行存單 7 天、28 天期 NCD 共 4,665.30 億元，截至昨日為止央行 NCD 未到期餘額為 73,401.40 億元。

昨日無特殊的緊縮因子，市場等待央行理監事會議開會結果，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 3,457.00 億元。央行理監事會議開會結果，貨幣政策央行決議利率不變，但調升存率一碼，預期短期利率隨之走高。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

113/06/14	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

2024.06.14

公債交易

昨日台債市場靜待央行理監事會議的結果，盤面僅成交一支指標五年券在 1.453%，較前次下滑 1.8bps，主要受美債利率回落帶動。本次央行會議結果如市場預期維持重貼現率不變，但調升存準率 1 碼，並實施第 6 波選擇性信用管制措施，另一方面，報告中上調全年經濟成長率預測值至 3.77% 及下修 CPI 年增至 2.12%。總裁楊金龍表示這次重點為房地產，升準可帶來量的緊縮，也有抑制通膨預期的作用。

國外方面，美國 5 月 PPI 年增 2.2%，低於市場預期的 2.5%，月減 0.2% 也低於預期的 0.1%；最新出領失業救濟金人數報 24.2 萬人，高於預期的 22.5 萬人為去年 9 月以來新高，疲軟的經濟數據加上三十年期國債標售結果穩健，終場十年期美債下滑 7.18bps 收在 4.2442%。

附：收盤行情表 (last bid)

年期	指標券種	6 月 12 日	6 月 13 日	漲跌(b. p.)
2 年	A13101	1.3100	1.3100	+0.00
5 年	A13105	1.4710	1.4530	-1.80
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