

2024.06.27

短期利率

昨日央行 NCD 到期 1,008.20 億元，央行發行存單 7 天、28 天期 NCD 共 1,567.00 億元，截至昨日為止央行 NCD 未到期餘額為 74,518.10 億元。

昨日，雖臨近月底出現一些缺口，部分投信的資金供給雖沒有上周充裕，但也不至於很緊縮，資金情勢大致平穩，短期利率仍是成交在區間高檔。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 1,660.50 億元，另有王道銀、合庫、新潤及日勝生等多檔債券交割共 102.00 億元。但因臨近月底，有些例行性資金需求顯現，加上還有多檔債券交割，預期短期利率仍將成交在區間高檔。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

113/06/27	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

2024.06.27

公債交易

昨日台債市場五年期 R 券在空方的帶動下續彈至 1.62%，較前一日上揚 2bps，3M TAIBOR 也持續以小碎步向上推升，目前台債氣氛仍屬偏空，市場謹慎操作下交投清淡。

國外方面，雖然美國沒有重要經濟數據公布，且五年期公債標售結果穩健，但同時日圓貶值至 38 年低點，市場擔憂日本央行將出面採取干預措施，美債利率承壓，終場十年期上彈 8.18bps 收在 4.3294%。

附：收盤行情表 (last bid)

年期	指標券種	6 月 25 日	6 月 26 日	漲跌(b. p.)
2 年	A13101	1.3100	1.3100	+0.00
5 年	A13105R	1.6000	1.6200	+2.00
10 年	A13107R	-	-	+0.00
20 年	A13109	-	-	+0.00
30 年	A13106	2.0110	2.0010	-1.00

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