

2024.06.18

短期利率

昨日央行 NCD 到期 3,378.00 億元，央行發行存單 7 天、28 天期 NCD 共 3,321.00 億元，截至昨日為止央行 NCD 未到期餘額為 73,153.70 億元。

昨日有部分投信出現較大的贖回，但銀行端及壽險資金還算充足，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 1.44%-1.54%。

今日有央行 NCD 到期 3,805.00 億元，另有台電公司債交割 107.5 億元。今天有公司債交割的緊縮因子，市場資金還算充裕下，預計影響有限，預期短期利率將成交在區間內。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

113/06/18	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%

2024.06.18

公債交易

週一部分停損盤賣壓出現，長端冷券殖利率走升，盤面五年券殖利率上升 8.7 bps 至 1.54%。

國外方面，週一公司債的大量發行再加上週二還有 130 億美元的 20 年期公債標售，增加籌碼端壓力。終場美國十年期公債殖利率上升 5.6 bps 至 4.277%。

附：收盤行情表 (last bid)

年期	指標券種	6 月 14 日	6 月 17 日	漲跌(b. p.)
2 年	A13101	1.3100	1.3100	+0.00
5 年	A13105	1.4530	1.5400	+8.70
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