

2024.06.20

短期利率

昨日央行 NCD 到期 3,015.50 億元，央行發行存單 7 天、28 天及 182 天期 NCD 共 3,235.50 億元，截至昨日為止央行 NCD 未到期餘額為 73,305.70 億元。

昨日投信端出現大額申購款，加上銀行及壽險也呈現多錢的態勢，市場資金充足，短期利率成交在區間內。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 3,497.50 億元，另有 2 年期 NCD 發行 250.0 億元的緊縮因子。雖有 NCD 交割，在市場資金寬鬆下，預期短期利率仍將成交在區間內。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

113/06/20	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%

2024.06.20

公債交易

週三盤面交投清淡，但交易員仍對央行未來動向存疑，處所近十年冷券殖利率交易在 1.69%-1.7%，突破週二新發行利率，長天期三十年冷券也站上 2% 大關，債市氣氛悲觀。

國外方面，美國因六月自由日休市一天。

附：收盤行情表 (last bid)

年期	指標券種	6月18日	6月19日	漲跌(b. p.)
2年	A13101	1.3100	1.3100	+0.00
5年	A13105	1.5400	1.5400	+0.00
10年	A13107	1.6660	1.6660	+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