

2024.06.17

短期利率

上週寬鬆因素有央行存單到期共 19,315.85 億元，緊縮因素有央行存單發行共 16,440.90 億，共減少發行 2,874.95 億元，上週端午節連續假期，加上信用卡繳稅上繳國庫，市場資金偏緊，短期利率成交在區間高檔。30 天期自保票利率成交在 1.50%-1.55%，隔拆加權平均利率收在 0.820%，公債 RP 利率成交在 1.09%-1.15%。公司債 RP 利率成交在 1.42%-1.50%。

本週寬鬆因素有央行存單到期共 15,919.00 億元，緊縮因素有公債、公司債及 NCD 發行共 869.5 億元。本週有不少債券交割的緊縮因子，資金需求增多，市場會保守因應，預期短期利率將有走升的壓力，預估本週隔夜拆款成交利率在 0.80%-0.85%，公債 RP 利率成交在 1.1%-1.2%，公司債 RP 利率成交在 1.44%-1.54%。

2024.06.17

公債交易

週五台債市場在預期短端利率未來將受到存準率上升而有走升的壓力，五、十年期公債報價區間同步上移，市場仍觀望本週公債得標結果，盤面交投清淡，指標券皆未成交。

國外方面，美國 6 月密大消費者信心指數初值下滑至 65.6，低於預期。一年/五年通膨預期分別報 3.3%/3.1%，略高於預估，終場美國十年期公債下跌 2.7 bps 至 4.217%。

附：收盤行情表 (last bid)

年期	指標券種	6 月 13 日	6 月 14 日	漲跌(b. p.)
2 年	A13101	1.3100	1.3100	+0.00
5 年	A13105	1.4530	1.4530	+0.00
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