

2024.05.15

短期利率

昨日央行 NCD 到期 4,000.00 億元，央行發行存單 7 天、28 天期 NCD 共 3,725.20 億元，截至昨日為止央行 NCD 未到期餘額為 78,240.15 億元。

昨日有中油及台塑公司債的緊縮因子，市場資金偏緊，軋平資金要花較多的時間，但短期利率則變化不大，仍是成交在區間內。公債 RP 利率主要成交在 1.07-1.15%，公司債 RP 利率成交在 1.40%-1.50%。

今日有央行 NCD 到期 2,951.20 億元。投信端依舊多缺不一，整體資金尚穩平穩，但月底前調度皆偏向保守，預料短利率能有機會朝區間高檔靠攏。預估本日公債 RP 利率成交在 1.07%-1.15%，公司債 RP 成交在 1.40%-1.50%。

附：債券附條件交易牌告利率

113/05/15	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

2024.05.15

公債交易

昨日台債市場交投依舊清淡，指標五年及十年券均無成交，市場等待美債給出方向指引，冷券市場買氣尚佳，不過操作上各方仍多偏保守觀望。

國外方面，美國公布 4 月 PPI 月增 0.5% 高於預期的 0.3%，年增 2.2% 則符合預期，數據一出打擊美債走勢，不過隨後 FED 主席鮑爾發言表示 PPI 報告好壞參半，因之前的數據被下修，並重申 FED 下一步不是升息，美債收復跌幅，終場十年期美債下滑 4.71bps 收在 4.4394%。

附：收盤行情表 (last bid)

年期	指標券種	5 月 13 日	5 月 14 日	漲跌(b. p.)
2 年	A13101	1.3750	1.3700	-0.50
5 年	A13105	1.5100	1.5100	+0.00
10 年	A13107	1.6250	1.6250	+0.00
20 年	A13102	1.8100	1.8100	+0.00
30 年	A13106	1.9400	1.9400	+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