

2024.06.21

短期利率

昨日央行 NCD 到期 3,497.50 億元，央行發行存單 7 天、28 天及 2 年期 NCD 共 3,683.10 億元，截至昨日為止央行 NCD 未到期餘額為 73,491.30 億元。

昨日雖有 2 年期 NCD 及中油公司債交割的緊縮因子，但在市場資金寬鬆下，並未受到太大影響，短期利率仍是成交在區間內。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 2,223.00 億元，另有公債 350 億及中油公司債 90 億元交割共 440.0 億元的緊縮因子。月底前持續有多檔債券交割，在市場資金仍然充裕下，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

113/06/21	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

2024.06.21

公債交易

週四指標十年券升破發行利率到 1.695%，預期未來資金緊縮下證券商寧可賠本出售也不願養券，指標三十年券也站上 2.02%，債市情緒更加不樂觀。

國外方面，初領失業救濟金人數 23.8 萬人高於預期，連續申請人數也增至 182.8 萬人，與 2021 年底的最高水準僅差一千人，勞動市場持續放緩，終場美國十年期公債殖利率上漲 2.7 bps 至 4.2497%。

附：收盤行情表 (last bid)

年期	指標券種	6 月 19 日	6 月 20 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	1.6950	+2.90
20 年	A13102	1.8100	1.8100	+0.00
30 年	A13106	1.9600	2.0200	+6.00