

2024.05.24

短期利率

昨日央行 NCD 到期 3,613.00 億元，央行發行存單 7 天、28 天期 NCD 共 3,548.50 億元，截至昨日為止央行 NCD 未到期餘額為 78,576.45 億元。

昨日投信端依舊多缺不一，而銀行、壽險端則大多可以續作，RP 利率維持平穩未變，主要仍是成交在區間內。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 2,591.50 億元，另有公債 A13106 期發行 250 億。雖有公債交割的緊縮因子，但因市場資金還算充裕下，預料影響有限，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 1.07%-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

113/05/24	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%

2024.05.24

公債交易

台灣 4 月工業生產指數年增 14.61%，主因受惠人工智慧、高速運算及雲端資料服務等需求持續成長，推升資訊電子產業生產動能續強，加上部分傳統產業因下游回補庫存而增產，以及上年同月比較基數相對偏低所致。週四受美債殖利率反彈影響，五年券盤面上彈 1.18 bps 至 1.4748%。

國外方面，美國 5 月 S&P 綜合 PMI 54.4 高於市場預期，經濟數據的強勁表現令市場擔憂通膨重新升溫，終場美國十年期公債殖利率上漲 5.3 bps 至 4.4748%。

附：收盤行情表 (last bid)

年期	指標券種	5 月 22 日	5 月 23 日	漲跌(b. p.)
2 年	A13101	1.3100	1.3100	+0.00
5 年	A13105	1.4630	1.4748	+1.18
10 年	A13107	1.6000	1.6000	+0.00
20 年	A13102	1.8100	1.8100	+0.00
30 年	A13106	1.9900	1.9900	+0.00