

2024.05.17

短期利率

昨日央行 NCD 到期 6,017.50 億元，央行發行存單 7 天、28 天及 2 年期 NCD 共 5,390.80 億元，截至昨日為止央行 NCD 未到期餘額為 77,698.45 億元。

昨日雖有二年期 NCD 交割的緊縮因子，但在市場短錢充斥下，並未受到影響亮，短期利率仍是成交在區間內。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 3,530.00 億元，另有台積電公司債發行 115 億元。雖有公司債交割的緊縮因子，但在市場資金充裕下，預計影響有限，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

113/05/17	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%

2024.05.17

公債交易

昨日台債市場指標五年券較前次成交下滑 5bps 收在 1.46%，不過僅成交一支，整體市場交投依舊清淡，靜待下週三十年券的標售結果。

國外方面，美國最新初領失業救濟金人數 22.2 萬人，稍高於市場預期的 22 萬人，不過較修正後前值減少 1 萬人。多位 FED 官員表示仍需要更多數據，以確定通膨率確實在向 2% 的目標邁進，建議仍應維持高利率政策，市場下修對今年的降息預期，終場十年期美債上揚 3.5bps 收在 4.375%。

附：收盤行情表 (last bid)

年期	指標券種	5 月 15 日	5 月 16 日	漲跌(b. p.)
2 年	A13101	1.3700	1.3700	+0.00
5 年	A13105	1.5100	1.4600	-5.00
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