

2024.05.21

## 短期利率

昨日央行 NCD 到期 3,618.00 億元，央行發行存單 7 天、28 天期 NCD 共 3,693.00 億元，截至昨日為止央行 NCD 未到期餘額為 77,824.45 億元。

昨日投信端多缺不一，但壽險及銀行資金充裕，整體市場資金情勢變化不大，大致上屬平穩狀態，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 3,664.50 億元。外資匯入，市場資金狀況呈現平穩偏小多狀態，投信和壽險資金相當充足，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

113/05/21	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

2024.05.21

## 公債交易

台灣 4 月外銷訂單 471.0 億美元，年增 10.8%，主因高效能運算、人工智慧及雲端產業等需求持續擴增，加上下游客戶回補庫存，以及部分原物料價格上漲所致。週一市場等待今日 30 年券標售結果，十年券盤面下跌 1.5 bps 至 1.61%。

國外方面，亞特蘭大聯準會總裁波斯提克表示一行需要一段時間才能確定通膨是否持續回落，副主席傑佛森也表示 4 月 CPI 數據預示未來情況還過早，終場美國十年期公債殖利率上漲 2 bps 至 4.4394%。

## 附：收盤行情表 (last bid)

年期	指標券種	5 月 17 日	5 月 20 日	漲跌(b. p.)
2 年	A13101	1.3100	1.3100	+0.00
5 年	A13105	1.4600	1.4600	+0.00
10 年	A13107	1.6250	1.6100	-1.50
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