

2024.05.16

短期利率

昨日央行 NCD 到期 2,951.20 億元，央行發行存單 7 天、28 天期 NCD 共 3,036.20 億元，截至昨日為止央行 NCD 未到期餘額為 78,325.15 億元。

昨日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，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 6,017.50 億元，另有二年期 NCD 發行 250 億元。雖有二年期 NCD 交割的緊縮因子，但在市場短錢充斥下，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

113/05/16	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

2024.05.16

公債交易

昨日台債市場指標券無成交，不過冷券市場稍有回溫，利率小幅向下成交。午後開標兩年期 NCD 得標平均利率落在 1.43%，落在預期的區間之內，較四月標售上揚 1.7bps。

國外方面，美國公布 4 月 CPI 年增 3.4% 符合市場預期，月增 0.3% 則低於預期及前值的 0.4%，核心 CPI 年增及月增也分別下降至 3.6% 及 0.3%，均符合市場預期，顯示通膨正在恢復下降趨勢，激勵美債大漲，終場十年期美債下滑 9.94bps 收在 4.34%。

附：收盤行情表 (last bid)

年期	指標券種	5 月 14 日	5 月 15 日	漲跌(b. p.)
2 年	A13101	1.3700	1.3700	+0.00
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