

2024.05.28

短期利率

昨日央行 NCD 到期 3,561.00 億元，央行發行存單 7 天、28 天期 NCD 共 3,257.50 億元，截至昨日為止央行 NCD 未到期餘額為 78,279.45 億元。

昨日雖有部分投信面臨較大的贖回，投信走錢較為明顯，不過銀行端資金相當寬裕，因此很快就將缺口補平，RP 利率成交在區間內。公債 RP 利率主要成交在 1.09-1.15%，公司債 RP 利率成交在 1.40%-1.50%。

今日有央行 NCD 到期 2,319.50 億元。月底最後一週，例行性資金需求，料將會逐日顯現，調度將會保守應對，短期利率有機會走高，但仍是成交在區間內。預估本日公債 RP 利率成交在 1.09%-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

113/05/28	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

2024.05.28

公債交易

時序接近月底，台債市場交投十分清淡，指標券僅成交一支十年券在 1.61%，較上週小幅上揚 0.2bps，下個月進入季月且有央行理監事會議的召開，各方操作將轉為保守，將難以提升整體成交量。

國外方面，美國因陣亡將士紀念日休市一天。

附：收盤行情表 (last bid)

年期	指標券種	5月24日	5月27日	漲跌(b. p.)
2年	A13101	1.3100	1.3100	+0.00
5年	A13105	1.4748	1.4748	+0.00
10年	A13107	1.6080	1.6100	+0.20
20年	A13102	1.8100	1.8100	+0.00
30年	A13106	1.9900	1.9900	+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