

2024.05.29

短期利率

昨日央行 NCD 到期 2,319.50 億元，央行發行存單 7 天、28 天期 NCD 共 2,078.00 億元，截至昨日為止央行 NCD 未到期餘額為 78,037.95 億元。

昨日投信端仍然持續解錢，但整體資金缺口並不大，RP 利率大致持平原有區間內。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 541.00 億元。投信端月底基金贖回壓力仍在，而銀行、壽險端資金供給尚稱平穩，但就是議價空間不大，讓 RP 利率持續高檔整理。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

113/05/29	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

2024.05.29

公債交易

昨日台債市場指標五年及十年券沒有成交，不過長端券種吸引小量買盤進場布局，指標三十年券成交在 1.96%，較得標利率 1.99% 下滑 3bps，不過在債市出現明確方向前，整體交投仍顯清淡。

國外方面，美國公布 5 月消費者信心指數意外上升，自 4 月修正後的 97.5 上升至 102，高於市場預期的 96，加上兩年及五年期美債發行需求疲軟，帶動殖利率曲線走揚，終場十年期美債上行 8.5bps 收在 4.55%。

附：收盤行情表 (last bid)

年期	指標券種	5 月 27 日	5 月 28 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	1.6100	1.6100	+0.00
20 年	A13102	1.8100	1.8100	+0.00
30 年	A13106	1.9900	1.9600	-3.00

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