

2024.05.20

短期利率

上週寬鬆因素有央行存單到期共 20,320.15 億元，緊縮因素有央行存單發行共 19,478.85 億，共減少發行 841.30 億元，上週有多檔債券交割，整體資金不似先前寬鬆，短期利率略微走高，但仍是成交在區間內。30 天期自保票利率成交在 1.50%-1.53%，隔拆加權平均利率收在 0.815%，公債 RP 利率成交在 1.07%-1.15%。公司債 RP 利率成交在 1.40%-1.50%。

本週寬鬆因素有央行存單到期共 16,344.50 億元，緊縮因素有 NCD 及公債發行共 250.00 億元。本週只有公債交割的緊縮因子，但因月底還有繳稅因素，市場調度仍會較為保守應對，預料短期利率有機會朝利率區間高檔靠攏，預估本週隔夜拆款成交利率在 0.80%-0.85%，公債 RP 利率成交在 1.07%-1.15%，公司債 RP 利率成交在 1.40%-1.50%。

2024.05.20

公債交易

週五台債市場等待本週三十年券標售結果，盤面上僅成交一支 2 年券在 1.31%。

國外方面，聯準會理事鮑曼重申預計通膨率將保持在高位一段時間，且如果未來的數據顯示通膨進展停滯或逆轉，將不排除升息的可能性，市場重新調整降息預期，終場美國十年期公債殖利率上漲 4.7 bps 至 4.4218%。

附：收盤行情表 (last bid)

年期	指標券種	5 月 16 日	5 月 17 日	漲跌(b. p.)
2 年	A13101	1.3700	1.3100	-6.00
5 年	A13105	1.4600	1.4600	+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

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