

2024.05.14

## 短期利率

昨日央行 NCD 到期 3,821.45 億元，央行發行存單 7 天、28 天期 NCD 共 3,745.65 億元，截至昨日為止央行 NCD 未到期餘額為 78,514.95 億元。

昨日市場資金不太充裕，投信和壽險均偏缺錢，但短期利率則變化不大，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 4,000.00 億元，另有中油及台塑公司債發行共 196.0 億元。今日有大額公司債交割，加上 5 月還有繳稅因素，月中過後市場調度會較為保守應對，預料短利率有機會朝區間高檔靠攏。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

113/05/14	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

2024.05.14

## 公債交易

昨日台債市場交投相當清淡，市場沒有太多的消息指引，靜待美國 PPI、CPI 數據的公布，以及下週三十年券投資盤的動向，指標五年及十年券均無成交。

國外方面，美國紐約聯邦準備銀行調查顯示，4 月消費者的一年通膨預期由前值 3% 上升至 3.26%，為去年 11 月來新高，數據出爐後美債漲勢收斂，終場十年期美債下滑 0.98bps 收在 4.4865%。

### 附：收盤行情表 (last bid)

年期	指標券種	5 月 10 日	5 月 13 日	漲跌(b. p.)
2 年	A13101	1.3750	1.3750	+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

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