

2024.05.22

短期利率

昨日央行 NCD 到期 3,664.50 億元，央行發行存單 7 天、28 天期 NCD 共 3,970.00 億元，截至昨日為止央行 NCD 未到期餘額為 78,129.95 億元。

昨日投信端多缺不一，但銀行與壽險資金供應穩定，多以到期續做為主，短期利率大致維持穩定，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 2,857.50 億元。貨幣市場無特殊的緊縮因子，市場仍維持寬鬆態勢，調度順暢，預期利率將持平於區間內。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

113/05/22	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

2024.05.22

公債交易

週二 30 年公債中標利率 1.99%，得標比重銀行業 69%、證券業 17.8%、保險業 13.2%，投標倍數 1.45，得標利率雖高於市場預期，但開標後市場反應平淡，尾盤時段雖有買方掛價低於得標利率但盤面仍未成交。

國外方面，聯準會官員沃勒表示未來 3 到 5 個月內的通膨數據若持續走弱，聯準會將在今年底或明年初開始降息，相關發言提振債市表現，終場十年期美債殖利率下跌 3.3 bps 至 4.41%。

附：收盤行情表 (last bid)

年期	指標券種	5 月 20 日	5 月 21 日	漲跌(b. p.)
2 年	A13101	1.3100	1.3100	+0.00
5 年	A13105	1.4600	1.4600	+0.00
10 年	A13107	1.6100	1.6100	+0.00
20 年	A13102	1.8100	1.8100	+0.00
30 年	A13106	1.9400	1.9900	+5.00