

2024.05.27

短期利率

上週寬鬆因素有央行存單到期共 16,344.50 億元，緊縮因素有央行存單發行共 17,178.00 億，共增加發行 833.50 億元，上週只有公債交割的緊縮因子，受到市場短錢充斥，整體資金還算充裕，短期利率維持平穩，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 1.09%-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 11,247.00 億元，緊縮因素有 NCD 發行。月底最後一週，市場例行性資金需求，料將會逐日顯現，調度將會保守應對，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 1.09%-1.15%，公司債 RP 利率成交在 1.40%-1.50%。

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

2024.05.27

公債交易

上週台債市場自三十年券標售後多跟隨國際市場波動，美國經濟數據強勁刺激美債利率走強，也帶動上週五指標十年券小幅上行 0.8bps 收在 1.608%。

國外方面，密西根大學公布 5 月份消費者信心指數終值 69.1，稍高於初值及經濟學家預估的 67.7，消費者預估未來 1 年及 5-10 年通膨預期分別為 3.3% 及 3%，均稍低於預期，不過市場對此報告反應冷淡，終場十年期美債下滑 1.17bps 收在 4.465%。

附：收盤行情表 (last bid)

年期	指標券種	5 月 23 日	5 月 24 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	1.6000	1.6080	+0.80
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