

2024.05.31

短期利率

昨日央行 NCD 到期 2,433.50 億元，央行發行存單 7 天、28 天期 NCD 共 1,874.50 億元，截至昨日為止央行 NCD 未到期餘額為 78,032.15 億元。

昨日投信端仍是面臨較大贖回，市場依舊保守應對，短期利率成交在區間高檔。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 2,392.00 億元。月底最後一天交易日，投信端仍將面臨較大贖回，市場資金偏緊，預期短期利率仍將成交在區間高檔。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

113/05/31	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

2024.05.31

公債交易

昨日台債交投依舊清淡，盤面僅成交一支指標十年券在 1.62%，較前一日小幅上行 1bp，主要受到美債利率彈升帶動，不過目前尚未刺激賣盤出籠，各方保守操作下，利率應維持於狹幅區間波動。

國外方面，美國第一季 GDP 折合年率 1.3%，較上月公布的初估值 1.6% 下修，符合市場預期，但其中個人消費及價格指數下修低於預期；最新初領失業救濟金人數 21.9 萬人，稍高於經濟學家預估的 21.7 萬人，一系列經濟數據提振投資人對後續降息的信心，終場十年期美債下滑 6.57bps 收在 4.546%。

附：收盤行情表 (last bid)

年期	指標券種	5月29日	5月30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	1.6200	+1.00
20年	A13102	1.8100	1.8100	+0.00
30年	A13106	1.9600	1.9600	+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