

2024.08.05

## 短期利率

上週寬鬆因素有央行存單到期共 10,679.80 億元，緊縮因素有央行存單發行共 13,104.80 億，共增加發行 2,425.0 億元，上週時序進入月底，雖有些例行性的贖回出現，及上市櫃公司現金股利發放，但因整體市場資金仍屬充裕，短期利率仍是成交在區間內。30 天期自保票利率成交在 1.50%-1.55%，隔拆加權平均利率收在 0.815%，公債 RP 利率成交在 1.10%-1.12%。公司債 RP 利率成交在 1.45%-1.55%。

本週寬鬆因素有央行存單到期共 17,565.0 億元，緊縮因素有 364 天期 NCD 及公司債發行共 1,520.0 億元。本週進入新提存期開始，加上月初持續有新的資金回流貨幣市場，將使得市場資金更為寬鬆，短期利率將朝區間的低檔靠攏。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 1.10%-1.12%，公司債 RP 利率成交在 1.45%-1.55%。

2024.08.05

## 公債交易

上週五台債市場受到美債利率回落帶動，指標五年及十年券均向下成交，指標五年券下滑 2bps 收在 1.47%，十年券則下滑 3bps 跌破 1.6% 關卡收在 1.57%。

國外方面，美國 7 月非農新增就業人數報 11.4 萬人，為 2020 年底以來新低，遠低經濟學家預期的 17.6 萬人，而 6 月的數據也由 20.6 萬人大幅下修至 17.9 萬人，失業率 4.3% 也高於前值及預期，疲弱的就業數據刺激美股大跌，十年期美債利率則大幅下滑 18.56bps 收在 3.7904%。

## 附：收盤行情表 (last bid)

年期	指標券種	8 月 1 日	8 月 2 日	漲跌(b. p.)
2 年	A13101	1.3100	1.3100	+0.00
5 年	A13105	1.4900	1.4700	-2.00
10 年	A13107R	1.6000	1.5700	-3.00
20 年	A13109	-	-	+0.00
30 年	A13106	1.8650	1.8650	+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