

2024.07.15

短期利率

上週寬鬆因素有央行存單到期共 16,739.60 億元，緊縮因素有央行存單發行共 15,626.00 億，共減少發行 1,113.6 億元，上週整體貨幣市場資金需求不高，加上央行仍持續沖銷，適度調節市場資金，整體資金狀況呈現平穩，短期利率成交在區間內。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 0.824%，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 17,126.10 億元，緊縮因素有 2 年期 NCD 及公債、公司債發行共 650.5 億元。本週有多檔債券交割，加上持續有上市櫃公司現金股利發放，市場資金需求增加，但因整體資金還算充裕，預期短期利率仍是成交在區間內。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%。

2024.07.15

公債交易

週五債市延續標售後的好氣氛，指標五年券殖利率下跌 3.7 bps 至 1.62%。

國外方面，美國 7 月份密大消費者信心指數初值下滑至 66，連四個月下降也是 8 個月來的低點，主因物價高漲另消費者卻步，而 6 月份 PPI 則是年增 2.6%，月增 0.2%，主因服務業成本上升，不過數據並未改變市場降息預期，週五美國十年期公債殖利率下跌 2.5 bps 至 4.1848%。

附：收盤行情表 (last bid)

年期	指標券種	7月11日	7月12日	漲跌(b. p.)
2年	A13101	1.3100	1.3100	+0.00
5年	A13105R	1.6570	1.6200	-3.70
10年	A13107R	1.7550	1.7550	+0.00
20年	A13109	-	-	+0.00
30年	A13106	1.9750	1.9750	+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