

2024.07.08

短期利率

上週寬鬆因素有央行存單到期共 11,522.60 億元，緊縮因素有央行存單發行共 11,899.50 億，共增加發行 376.9 億元，上週為月初開始，在季底法人作帳結束後，資金陸續回籠，整體市場資金恢復寬鬆態勢，短期利率成交在區間低檔。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 0.825%，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 16,739.60 億元，緊縮因素有 NCD 發行。本週旬初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，整體資金狀況仍將偏向寬鬆，短期利率可持穩在區間內。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%。

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

2024.07.08

公債交易

台灣 6 月份 CPI 年增 2.42%，略高於市場預期，其中受到近期多雨的影響下食物類別漲幅最大，而夏季電價以及租金上漲等因素也讓居住類別維持高檔。週五盤面僅五年券平盤收在 1.67%。

國外方面，美國 6 月非農就業人數新增 20.6 萬人，較五月人數放緩，同時失業率也上升到 4.1%，終場美國十年期公債直利率下跌 8.2 bps 至 4.2764%。

附：收盤行情表 (last bid)

年期	指標券種	7 月 4 日	7 月 5 日	漲跌(b. p.)
2 年	A13101	1.3100	1.3100	+0.00
5 年	A13105R	1.6700	1.6700	+0.00
10 年	A13107R	1.7525	1.7525	+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