

2021.08.03

## 短期利率

昨日央行 NCD 到期 764.70 億元，央行發行 7 天、28 天共 1,129.70 億元，截至昨日為止央行 NCD 未到期餘額為 92,968.20 億元。

昨日附買回市場，投信有進有出，但多以到期續做為主，整體市場資金屬平穩，昨日公債 RP 成交在 0.16%-0.18%，公司債 RP 成交 0.18%~0.21%。

今日寬鬆因素有央行 NCD 到期 2,290.90 億，緊縮因素有瑞士信貸銀行(倫敦)發行 1.25 億南非幣債。預估今日市場平穩，提存期初市場資金較多，投信多有找券需求，預估 RP 利率將在區間內成交。預計本日公債 RP 利率成交在 0.16%-0.18%，公司債 RP 成交在 0.18%~0.21%。

### 附：債券附條件交易牌告利率

110/08/03	10 天	20 天	30 天	60 天	90 天
RP	0.1%	0.1%	0.1%	0.1%	0.1%
RS	1.1%	1.1%	1.1%	1.1%	1.1%

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

2021.08.03

## 公債交易

昨日隨美債殖利率下滑小幅下行，台灣十年期 R 券成交兩支收在 0.3975%，不過整體而言台債市場仍選擇觀望周五的標債結果，向下追價動力不足。

美國 7 月 ISM 製造業採購經理人指數 59.5，雖仍處擴張但已連續兩個月下滑，其中未完成訂單指數從前一個月的 64.5 上升至 65，而反映交貨時間的供應商交貨指數則從 75.1 回落至 72.5，顯示在勞工及原物料短缺下，供應鏈的瓶頸持續存在，但相較 6 月有些微緩解。投資人的關注焦點放在 delta 病毒是否將影響經濟的復甦，十年期美債殖利率再度跌破 1.2% 的關卡，終場收在 1.1839%，較前一日下滑 3.84bps。

### 附：收盤行情表 (last bid)

年期	指標券種	7 月 30 日	8 月 2 日	漲跌(b. p.)
2 年	A10106	0.1570%	0.1570%	0.00
5 年	A10108	0.2830%	0.2830%	0.00
10 年	A10107	0.4050%	0.3980%	-0.70
20 年	A10105	0.5135%	0.5135%	0.00
30 年	A10104	0.6000%	0.6000%	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