

2021.07.23

## 短期利率

昨日央行 NCD 到期 1,126.00 億元，央行發行 7 天、28 天共 1,202.70 億元，截至昨日為止央行 NCD 未到期餘額為 91,362.00 億元。

昨日附買回市場資金有進有出，雖最終仍可做平，但資金調度不如月初容易，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 834.00 億元，緊縮因素有土地銀行發行 10 億台幣金融債。預估今日市場仍偏緊，投信、壽險各家多缺一狀況仍在，預估 RP 利率將在區間內高檔成交。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

110/07/23	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

2021.07.23

## 公債交易

昨日台債等殖盤面無成交，雖然美債殖利率回彈但台債沒什麼太多反應，市場交投意願冷淡，等待下周五年券的標售。

美國最新初領失業救濟金人數意外上升至 5 月中以來最高，截至 7/17 報 41.9 萬人，較預期的 35 萬人高，由於增加人口主要集中在幾個以汽車生產為主的地區，經濟學家表示車廠每年夏天會短暫關閉工廠，以便對新車生產做準備，此周應為季節性調整影響，美債殖利率受消息影響而回落，不過終場收斂跌幅，十年期美債終場收在 1.2783%，較前一日下滑 1.01bps。

### 附：收盤行情表 (last bid)

年期	指標券種	7 月 21 日	7 月 22 日	漲跌(b. p.)
2 年	A10106	0.1580%	0.1580%	0.00
5 年	A10101	0.2470%	0.2470%	0.00
10 年	A10107	0.3910%	0.3910%	0.00
20 年	A10105	0.5350%	0.5250%	-1.00
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