

2024.04.03

## 短期利率

昨日央行 NCD 到期 1,944.70 億元，央行發行存單 7 天、28 天期 NCD 共 2,332.70 億元，截至昨日為止央行 NCD 未到期餘額為 76,620.35 億元。

昨日月初有新資金回流市場，加上需求少，短期利率微幅下滑，但仍是成交在區間內。公債 RP 利率主要成交在 1.05-1.15%，公司債 RP 利率成交在 1.40%-1.50%。

今日有央行 NCD 到期 1,669.00 億元。清明連假前，投信端可能出現多缺不一的情況，但整體資仍屬平穩，短期利率波動不大，仍將成交在區間內。預估本日公債 RP 利率成交在 1.05%-1.15%，公司債 RP 成交在 1.40%-1.50%。

### 附：債券附條件交易牌告利率

113/04/03	10 天	20 天	30 天	60 天	90 天
RP	0.55%	0.55%	0.55%	0.55%	0.55%
RS	1.55%	1.55%	1.55%	1.55%	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

2024.04.03

## 公債交易

昨日台債市場空頭氣氛仍然濃厚，過了季底資金緊俏情事尚未改善，加上美債利率有顯著的彈幅，再度刺激停損賣壓出籠，指標十年券 A13107 上揚 1.9bps 收在 1.464%。

國外方面，美國 2 月份 JOLTS 職位空缺數 875.6 萬個小幅高於市場預期，也較修正後前值增加 8,000 個職缺，主要來自政府及金融部門，離職率維持在 2.2%，為 2020 年以來新低，顯示勞動市場仍具韌性，終場十年期美債上彈 3.99bps 收在 4.3491%。

### 附：收盤行情表 (last bid)

年期	指標券種	4 月 1 日	4 月 2 日	漲跌(b. p.)
2 年	A13101	1.0900	1.0900	+0.00
5 年	A13103	1.3550	1.3750	+2.00
10 年	A13107	1.4450	1.4640	+1.90
20 年	A13102	1.5075	1.5075	+0.00
30 年	A12111	1.6700	1.6750	+0.50

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