

2024.04.08

## 短期利率

上週寬鬆因素有央行存單到期共 6,982.70 億元，緊縮因素有央行存單發行共 7,354.70 億，共增加發行 372.0 億元，上週市場擺脫了月底資金緊俏的情況，恢復較為寬鬆狀態，短期利率略微下滑，不過幅度也不太大，仍是成交在區間內。30 天期自保票利率成交在 1.42%-1.52%，隔拆加權平均利率收在 0.819%，公債 RP 利率成交在 1.05%-1.15%。公司債 RP 利率成交在 1.40%-1.50%。

本週寬鬆因素有央行存單到期共 14,656.60 億元，緊縮因素有 364 天期 NCD 及公司債發行共 1,516.0 億元。本週雖有長天期 NCD 及公司債交割的緊縮因子，不過在市場資金仍然充裕下，預計影響有限，短期利率仍應成交在區間內。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 1.05%-1.15%，公司債 RP 利率成交在 1.40%-1.50%。

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

2024.04.08

## 公債交易

週三市場觀察的一年期定期存單得標利率在 1.352%，高於市場預期，不過台債適逢連假前交易清淡，盤面上未有指標券成交。

國外方面，美國三月非農就業新增 30.3 萬人，創一年以來最大增幅，且失業率從 3.9% 降至 3.8%，強勁的就業數據讓市場預期聯準會降息時程將延後，終場十年期公債殖利率收在 4.40%。

### 附：收盤行情表 (last bid)

年期	指標券種	4 月 2 日	4 月 3 日	漲跌(b. p.)
2 年	A13101	1.0900	1.0900	+0.00
5 年	A13103	1.3750	1.3750	+0.00
10 年	A13107	1.4640	1.4640	+0.00
20 年	A13102	1.5075	1.5075	+0.00
30 年	A12111	1.6750	1.6750	+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