

2024.04.29

短期利率

上週寬鬆因素有央行存單到期共 17,005.70 億元，緊縮因素有央行存單發行共 17,448.50 億，共增加發行 442.80 億元，上週整體市場資金狀況持續寬鬆，雖有公債公司債交割等緊縮因素及投信的近月底贖回效應，短期利率持穩在區間內。30 天期自保票利率成交在 1.44%-1.52%，隔拆加權平均利率收在 0.816%，公債 RP 利率成交在 1.07%-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 10,486.70 億元，緊縮因素有公司債發行共 30.00 億元。本週進入 5 月開始應對月底繳稅的變數，雖有股市短期波動劇烈下的資金暫停泊在貨幣市場，資金調度仍偏保守看待，短期利率將成交在區間內。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 1.07%-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

2024.04.29

公債交易

上週五台債市場交投相當清淡，在利率經歷大幅彈升後目前稍喘口氣，指標五年及十年券均無成交，關注本週 FOMC 的會議結果。

國外方面，美國 3 月 PCE 及核心 PCE 月增均持平於 0.3%，符合市場預期，稍微緩和市場對通膨黏性的擔憂，美債利率自年內高點回落，十年期美債終場收在 4.669%，較前一日下滑 3.7bps。

附：收盤行情表 (last bid)

年期	指標券種	4 月 25 日	4 月 26 日	漲跌(b. p.)
2 年	A13101	1.3750	1.3750	+0.00
5 年	A13105	1.5860	1.5860	+0.00
10 年	A13107	1.6680	1.6680	+0.00
20 年	A13102	1.8100	1.8100	+0.00
30 年	A12111	1.7500	1.7500	+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