

# 致和證券 債券部週報

2024/04/15

## 上週成交日國內金融市場概況

日期	市場附條件買回利率	隔夜拆款平均利率	債券市場			新台幣匯率
			5年	10年	20年	
			A09101	A09103	A09104	
04/08	0.55	0.812	1.2500	1.2005	1.3950	32.098
04/09	0.55	0.814	1.2500	1.2005	1.3950	32.098
04/10	0.55	0.812	1.2500	1.2005	1.3950	32.020
04/11	0.55	0.813	1.2700	1.2005	1.3950	32.211
04/12	0.55	0.817	1.2605	1.2005	1.3950	32.293

## 上週成交日國外金融市場概況

日期	美元指數	SOFR 利率	TED 價差	美元兌日幣	美元兌人民幣
04/08	104.14	5.28	18.314	151.865	7.24635
04/09	104.11	5.28	20.337	151.905	7.24470
04/10	105.18	5.28	15.563	151.845	7.24200
04/11	105.27	5.31	19.777	153.195	7.25550
04/12	106.01	5.31	20.057	153.245	7.26180

## 上週公佈的重要經濟指標及數據

經濟指標內容	公佈日期	結果	前期比較
美國 3 月消費者物價指數 CPI(年增率)	04/10	3.5%	+0.3%
美國 3 月生產者物價指數 PPI(年增率)	04/11	2.1%	+0.5%
美國 4 月密大消費者信心指數	04/12	77.9	-1.5

### 台灣目前經濟指標

經濟指標內容	月份	數值	前期	下次發布日期
領先指標	2024/02	101.68	101.37	2024/04/26
同時指標	2024/02	100.41	99.99	2024/04/26
落後指標	2024/02	96.31	102.14	2024/04/26

### 本週資金寬鬆緊縮因數

寬鬆因素		緊縮因素	
因數	金額(億)	因數	金額(億)
04/15 NCD 到期	4,258.05	NCD 發行	250
04/16 NCD 到期	4,753.50	公債發行	350
04/17 NCD 到期	3,053.20	公司債發行	54.5
04/18 NCD 到期	6,011.50		
04/19 NCD 到期	3,713.60		
合計	21,789.85		

### 本週投資建議

#### 台灣

5 年期公債 A09101	10 年期公債 A09103	20 年期公債 A09104
1.19%~1.29%	1.16%~1.26%	1.34%~1.45%

#### 美國

5 年期公債	10 年期公債	20 年期公債
4.51~4.61%	4.47%~4.57%	4.67%~4.77%

### 未來重大財經訊息

- 04/15 美國 3 月零售銷售(月增率)
- 04/16 美國 3 月新屋開工(月增率)
- 04/18 美國前周初次申請失業救濟金人數