

2022.04.19

## 短期利率

昨日央行 NCD 到期 4,594.85 億元，央行發行存單 7 天、28 天及 2 年期共 4,739.45 億元，截至昨日為止央行 NCD 未到期餘額為 91,933.60 億元。

附買回市場方面，因有兩年期定存單 600 億的交割，市場資金不算充裕，但週一缺口不大以到期續作為主，短率持穩近期高位。昨日公債 RP 成交在 0.30%-0.35%，公司債 RP 成交在 0.35%-0.40%。

今日寬鬆因素有央行 NCD 到期 3,836.90 億元，緊縮因素有央行持續沖銷及元大金控公司債發行 53 億元。近日隔拆利率處於高位，市場資金需求升溫。預估本日公債 RP 利率成交在 0.30%-0.35%，公司債 RP 成交在 0.35%-0.42%。

### 附：債券附條件交易牌告利率

111/4/19	10 天	20 天	30 天	60 天	90 天
RP	0.15%	0.15%	0.15%	0.15%	0.15%
RS	1.2%	1.2%	1.2%	1.2%	1.2%

2022.04.19

## 公債交易

昨日台債市場因短線利率上彈幅度已高，上週標債過後引發空單獲利回補，造成利率下跌，昨日指標 5 年券下行 5.05 bps 收在 1.0345%，指標 10 年券下行 1.8 bps 收在 1.255%。

國外方面，美國聖路易聯準銀總裁布拉德 18 日表示，Fed 應該多次升息 2 碼，以平抑通膨，而且不應排除一次升息 3 碼的可能性，儘管他預期尚無此必要。此外，美元指數也因美債利率創高而創下兩年新高來到 100.82。昨日 10 年期美債終場上揚 2.9bps 收在 2.857%。

### 附：收盤行情表 (last bid)

年期	指標券種	4 月 15 日	4 月 18 日	漲跌(b. p.)
2 年	A10109	0.4599	0.4599	+0.00
5 年	A11106	1.0850	1.0345	-5.05
10 年	A11107	1.2730	1.2550	-1.80
20 年	A11104	1.1495	1.1495	+0.00
30 年	A10113	1.1060	1.1060	+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