

2022.05.10

短期利率

昨日央行 NCD 到期 517.70 億元，央行發行存單 7 天及 28 天期共 609.70 億元，截至昨日為止央行 NCD 未到期餘額為 90,777.70 億元。

銀行間資金多缺不一，週初資金需求不大，拆款及短票利率尚穩定，附買回市場方面，僅以到期續作為主。昨日公債 RP 成交在 0.30%-0.32%，公司債 RP 成交在 0.35%-0.45%。

今日寬鬆因素有央行 NCD 到期 1,550.10 億元，緊縮因素有央行持續沖銷。整體市場資金不算太充裕，銀行對利率有所堅持，短期內利率沒有太大的議價空間。預估本日公債 RP 利率成交在 0.30%-0.32%，公司債 RP 成交在 0.35%-0.45%。

附：債券附條件交易牌告利率

111/5/10	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%

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

2022.05.10

公債交易

台債市場空頭氣氛濃厚，伴隨著美債創新高，指標 5 年、10 年公債殖利率續創今年新高。目前市場氣氛空頭氣焰，銀行投資盤進場意願不高，昨日指標 10 年券上行 5.47 bps 收在 1.3897%，指標 5 年券上行 5.9bps 收在 1.149%。

國外方面，市場預期通膨和 FED 利率政策的不利發展，尤其若伴隨經濟活動降溫，可能對金融體系帶來負面影響，擔憂美國經濟可能陷入衰退，進而對就業和企業投資產生負面影響，昨日 10 年期美債利率終場下行 4.4 bps 收在 3.08%。

附：收盤行情表 (last bid)

年期	指標券種	5 月 6 日	5 月 9 日	漲跌(b. p.)
2 年	A10109	0.8495	0.8495	+0.00
5 年	A11106	1.0900	1.1490	+5.90
10 年	A11107	1.3350	1.3897	+5.47
20 年	A11104	1.1495	1.1495	+0.00
30 年	A10113	1.7100	1.7100	+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