

2022.04.08

短期利率

昨日央行 NCD 到期 5,143.75 億元，央行發行存單 7 天及 28 天期共 5,331.25 億元，截至昨日為止央行 NCD 未到期餘額為 91,835.20 億元。

附買回市場方面，月初資金供應平穩偏向淡靜，仍關注在美升息的前景下，外資與本地資金的匯出動向。昨日公債 RP 成交在 0.26%-0.30%，公司債 RP 成交在 0.32%-0.42%。

今日寬鬆因素有央行 NCD 到期 5,114.80 億元，緊縮因素有央行持續沖銷，永豐銀金融債交割 20 億元。近日以投信貨幣型基金的短錢較多，對利率雖不若銀行與壽險堅持也只能偏短承作，短率往區間低位靠近。預估本日公債 RP 利率成交在 0.26%-0.30%，公司債 RP 成交在 0.32%-0.42%。

附：債券附條件交易牌告利率

111/4/8	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

2022.04.08

公債交易

昨日台債市場 5 年增額券發行前交易小幅回落，但交易量零星較無代表性，昨日指標十年券收在 1.1%，指標五年券收在 1.005%。

國外方面，上周初領失業救濟金人數下滑至 16.6 萬人，初領失業金人數下滑可看成就業市場積極的跡象，聖路易聯邦準備銀行總裁布拉表示 Fed 在對抗通膨方面仍然落後於市場。央行將持續將貨幣政策焦點放在平抑通膨上，十年期美債終場上行 6.7bps 收在 2.665%。

附：收盤行情表 (last bid)

年期	指標券種	4 月 6 日	4 月 7 日	漲跌(b. p.)
2 年	A10109	0.4599	0.4599	+0.00
5 年	A11106	1.0050	1.0050	+0.00
10 年	A11107	1.1000	1.1000	+0.00
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