

2022.04.07

短期利率

昨日央行 NCD 到期 2,115.70 億元，央行發行存單 7 天、28 天期及 364 天期共 6,410.25 億元，截至昨日為止央行 NCD 未到期餘額為 91,647.70 億元。

附買回市場方面，由於月初加上缺口小，市場資金供應平穩，雖利率多有向下議價空間但成交筆數不多。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 5,143.75 億元，緊縮因素有央行持續沖銷，台達電公司債交割 66 億元。進入新提存期及月初，資金調度彈性大，短期利率區間仍偏寬。預估本日公債 RP 利率成交在 0.25%-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

111/4/7	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

2022.04.07

公債交易

昨日台債市場受到 10 年期指標美債殖利率再創波段新高，帶動台債指標券利率向上成交，因連假醞釀的壓力也一次釋放，但交投仍呈現冷清，昨日指標十年券收在 1.1%，上行 15 bps，指標五年券上行 8.25 bps 收在 1.005%。

國外方面，昨日公布之 FOMC 會議紀要顯示，多名決策官員認為，未來「一次或多次」升息 2 碼是適當的行動，並且可能在 5 月開始透過每月出售 600 億美元的公債及 350 億美元的 MBS 進行縮表，致使十年期美債終場上行 5.2bps 收在 2.606%。

附：收盤行情表 (last bid)

年期	指標券種	4 月 1 日	4 月 6 日	漲跌(b. p.)
2 年	A10109	0.4599	0.4599	+0.00
5 年	A11106	0.9225	1.0050	+8.25
10 年	A11107	0.9500	1.1000	+15.00
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