

2022.04.14

短期利率

昨日央行 NCD 到期 9,268.60 億元，央行發行存單 7 天、28 天及 182 天期共 8,916.90 億元，截至昨日為止央行 NCD 未到期餘額為 91,857.40 億元。

附買回市場方面，主要轉向銀行承作，從銀行間的拆款利率報價差距收斂，可見資金有適度寬鬆的空間。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 3,408.50 億元，緊縮因素有央行持續沖銷，中租控股公司債交割 80 億元。外資此前連六日的賣超台股仍需觀察近期的匯出狀況。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

111/4/14	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

2022.04.14

公債交易

隨美債利率回落，週五即將標售之十年增額券也跟進回落 3.8bps 收在 1.23%，不過市場觀望氣氛濃厚，整體交投冷清，指標五年及十年券均無成交。

國外方面，美國 3 月 PPI 年增 11.2% 高於市場預期，創有此項統計數據以來最高，顯示通膨壓力仍高，但美債利率再小幅彈升後仍繼續回落，十年期美債終場下滑 2.26bps 收在 2.6987%

附：收盤行情表 (last bid)

年期	指標券種	4 月 11 日	4 月 12 日	漲跌(b. p.)
2 年	A10109	0.4599	0.4599	+0.00
5 年	A11106	1.1350	1.1350	+0.00
10 年	A11107	1.2850	1.2850	+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