

2019.05.21

## 短期利率

昨日央行 NCD 到期 2,148.00 億元，央行發行 28 天、91 天及 182 天期存單共 2,148.00 億元，截至昨日為止 NCD 未到期餘額為 7 兆 8,457.70 億元。

附買回市場，昨日市場無特殊緊縮因子，呈現穩中偏鬆的態勢，RP 利率較前週無太大的變化。昨日公債 RP 區間在 0.37%~0.42%，公司債 RP 區間在 0.50~0.52%。

今日有央行 NCD 到期 1,921.00 億元的寬鬆因子，無其他交割緊縮因子。預料整體市場資金平穩，投信及銀行端資金供給較為充裕，RP 利率應維持於區間之內。預估公債 RP 利率將成交在 0.37%-0.42%，公司債 RP 將成交在 0.50%~0.52%。

### 附：債券附條件交易牌告利率

108/05/16	10 天	20 天	30 天	60 天	90 天
RP	0.25%	0.25%	0.25%	0.25%	0.25%
RS	1.25%	1.25%	1.25%	1.25%	1.25%

2019.05.21

## 公債交易

國際債市沒有新指引，十年指標公債在平盤附近震盪，整體成交量不是很高，收於平盤附近，十年債 A08103 收 0.7208%，五年債 A08101 收在 0.575%。

十年美債昨日小幅度收揚在 2.419%，美國沒有公布重要數據，行情主要由消息面主導，歐元區及英國公債短線反彈帶動美債利率走揚，繼 Google 後，高通及 intel 也傳出中止與華為合作關係，後續影響如何發酵有待觀察，另外也關注 Fed 官員們本週的談話。

### 附：收盤行情表 (last bid)

年期	指標券種	5月17日	5月20日	漲跌(b.p.)
2年	A07112	0.4880%	0.4880%	0.00
5年	A08101	0.5800%	0.5750%	-0.50
10年	A08103	0.7200%	0.7208%	0.08
20年	A08104	1.0010%	1.0010%	0.00
30年	A08105	1.1200%	1.1200%	0.00