

2022.04.28

短期利率

昨日央行 NCD 到期 4,045.70 億元，央行發行存單 7 天、28 天及 182 天期共 3,619.70 億元，截至昨日為止央行 NCD 未到期餘額為 90,745.90 億元。

外資及壽險持續走錢，市場資金緊俏，銀行間資金調度困難，拆款利率持續走升，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%-0.35%，公司債 RP 成交在 0.35%-0.45%。

今日寬鬆因素有央行 NCD 到期 2,252.50 億元，緊縮因素有央行持續沖銷。雖銀行減申購存單回補積數但吃緊的資金情勢未變，短票利率攀升，債券附買回利率靠向區間高位。預估本日公債 RP 利率成交在 0.30%-0.35%，公司債 RP 成交在 0.35%-0.48%。

附：債券附條件交易牌告利率

111/4/28	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%

2022.04.28

公債交易

昨日台債市場，因隨著美債利率下滑而持續小幅回落，市場多在等待 5 月 FOMC 會議結果，且台灣央行升息壓力仍在，因此多方追價意願皆不高，目前以利率漲多回跌修正看待，昨日指標 5 年券無成交收在 1.0301%，指標 10 年券下跌 2bps 收在 1.22%。

國外方面，因美國股市短線止跌，避險恐慌情緒稍微降溫，加上市場預期重回反應 Fed 將激進升息的因素，昨日 10 年期美債利率重回 2.8% 之上，終場上行 4.4bps 收在 2.817%。

附：收盤行情表 (last bid)

年期	指標券種	4 月 26 日	4 月 27 日	漲跌(b. p.)
2 年	A10109	0.7447	0.7447	+0.00
5 年	A11106	1.0301	1.0301	+0.00
10 年	A11107	1.2400	1.2200	-2.00
20 年	A11104	1.1495	1.1495	+0.00
30 年	A10113	1.1060	1.1060	+0.00