

2022.04.01

短期利率

昨日央行 NCD 到期 2,111.85 億元，央行發行存單 7 天及 28 天期共 2,300.10 億元，截至昨日為止央行 NCD 未到期餘額為 91,268.65 億元。

附買回市場方面，由於銀行間積數回補進入尾聲，加上提前排開落點資金需求不大，短期利率成交在區間高檔。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 2,115.70 億元，緊縮因素有央行持續沖銷，公司債 52.30 億元及國庫券 300 億元發行。接下來清明連續假期，仍令調度較謹慎，短期利率持堅。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

111/4/1	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

2022.04.01

公債交易

昨日台債交投冷清，零星季底作帳行情使台債利率小幅下行，指標十年券收在 0.95%，較前日下滑 1bp，五年券則下滑 2bps 收在 0.85%。

國外方面，美國 2 月 PCE 年增 6.4% 創 39 年來新高，核心 PCE 年增 5.4% 略低於市場預期，而通膨上升壓力也影響 2 月個人支出僅月增 0.2%，不過市場對於數據反應冷淡，十年期美債終場下滑 1.08bps 收在 2.338%。

附：收盤行情表 (last bid)

年期	指標券種	3 月 30 日	3 月 31 日	漲跌(b. p.)
2 年	A10109	0.4599	0.4599	+0.00
5 年	A11106	0.8700	0.8500	-2.00
10 年	A11107	0.9600	0.9500	-1.00
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