

2022.05.11

## 短期利率

昨日央行 NCD 到期 1,550.10 億元，央行發行存單 7 天及 28 天期共 730.10 億元，截至昨日為止央行 NCD 未到期餘額為 89,957.70 億元。

銀行間資金多缺不一情況持續，拆款及短票利率大致持穩，附買回市場方面，來自法人較低成本資金充沛或多或少彌補投信贖回的資金缺口。昨日公債 RP 成交在 0.30%-0.32%，公司債 RP 成交在 0.35%-0.45%。

今日寬鬆因素有央行 NCD 到期 8,769.50 億元，緊縮因素有央行持續沖銷。整體市場資金延續不充裕，短期利率欲低不易的情況下。預估本日公債 RP 利率成交在 0.30%-0.32%，公司債 RP 成交在 0.35%-0.45%。

### 附：債券附條件交易牌告利率

111/5/11	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

2022.05.11

## 公債交易

台債市場，因美債回落指標 10 年公債殖利率小幅回檔。但因目前市場氣氛空頭仍在，買盤進場意願不高，短線仍以高檔盤整為主，昨日指標 10 年券下行 1.77 bps 收在 1.372%，指標 5 年券收在 1.149%。

國外方面，美國 CPI 公布前夕，市場對於未來通膨展望稍有降低，經濟學家普遍預期通膨壓力有機會觸頂，而美國 10 年期公債殖利率也從三年多高點拉回，昨日 10 年期美債利率終場下行 9 bps 收在 2.99%。

### 附：收盤行情表 (last bid)

年期	指標券種	5 月 9 日	5 月 10 日	漲跌(b. p.)
2 年	A10109	0.8495	0.8495	+0.00
5 年	A11106	1.1490	1.1490	+0.00
10 年	A11107	1.3897	1.3720	-1.77
20 年	A11104	1.1495	1.1495	+0.00
30 年	A10113	1.7100	1.8600	+15.00

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