

2021.10.27

## 短期利率

昨日央行 NCD 到期 407.90 億元，央行發行存單 7 天、28 天共 786.40 億元，截至昨日為止央行 NCD 未到期餘額為 91,701.20 億元。

昨日附買回市場緊張情緒已漸漸消退，資金狀況平穩，但短率區間已經墊高，目前 RP 部分大多續做，RP 利率區間橫盤震盪，昨日公債 RP 成交在 0.15%-0.20%，公司債 RP 成交 0.19%~0.29%。

今日寬鬆因素有央行 NCD 到期 9,323.20 億元，緊縮因素有央行持續沖銷及金融債發行 20 億元，台灣及美國公債利率彈升帶來的緊張情緒已漸漸平穩，但通膨與升息預期仍帶給短率上升風險，短率近期或將橫盤震盪。預估本日公債 RP 利率成交在 0.15%-0.20%，公司債 RP 成交在 0.20%~0.29%。

### 附：債券附條件交易牌告利率

110/10/27	10 天	20 天	30 天	60 天	90 天
RP	0.1%	0.1%	0.1%	0.1%	0.1%
RS	1.1%	1.1%	1.1%	1.1%	1.1%

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

2021.10.27

## 公債交易

隨著近日美債彈勢止穩，市場的空頭氣氛也稍有緩和，不過觀察冷券市場仍有部分券種的停損賣盤出籠，昨日指標五年及十年券均無成交。

美國 10 月份消費者信心指數出現四個月來首次上升，從上個月的 144.3 升至 147.4，不過觀察美債走勢，市場似乎逐步消化高通膨的擔憂，十年期美債終場下滑 2.28bps 回至 1.6% 的關卡，三十年期美債則下滑 4.05bps 收在 2.0407%。

### 附：收盤行情表 (last bid)

年期	指標券種	10 月 25 日	10 月 26 日	漲跌(b. p.)
2 年	A10109	0.3506	0.3506	+0.00
5 年	A10108	0.4350	0.4350	+0.00
10 年	A10111R	0.5700	0.5700	+0.00
20 年	A10110	0.6760	0.6760	+0.00
30 年	A10104	0.6900	0.6900	+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