2026.10.30

短期利率

昨日央行 NCD 到期 2,601.00 億元，發行存單 7 天、28 天期 NCD 共 2,631.00 億元，截至昨日為止央行 NCD 未到期餘額為 58,339.50 億元。

昨日交投偏淡靜，臨近月底市場資金仍平穩充裕，短率大致不變。昨日公債 RP 利率主要成交在 1.15-1.20%，公司債 RP 利率成交在 1.43%-1.60%。

今日有央行 NCD 到期 1,595.00。預計外商銀有不少短錢要丟出，因此月底雖近，但絲毫感受不到緊俏，市況料可維持充裕。預估本日公債 RP 利率成交在 1.15-1.20 %，公司債 RP 成交在 1.43%-1.60%。

附：債券附條件交易牌告利率

115/10/30	10 天	20 天	30 天	60 天	90 天
RP	0.60%	0.60%	0.60%	0.60%	0.60%
RS	2.00%	2.00%	2.00%	2.00%	2.00%

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

2026.10.30

公債交易

週四盤面交投冷清，指標券未見成交。

國外方面，美國第三季 GDP 年化季增 3.4%高於預期，民間消費年化季增 3.8%同樣高於預期，反映民間消費維持韌性、企業投資強勁共同支撐經濟，9 月 PCE 月增升至 0.5%，年增 3.6%，核心 PCE 月增 0.3%皆符合預期，短期通膨仍使 Fed 維持警界不過通膨擴散程度有所改善，美債受到科技股下跌帶動避險買盤支撐令殖利率回落，終場十年公債收在 4.94%。
。

附：收盤行情表 (last bid)

年期	指標券種	10 月 28 日	10 月 29 日	漲跌(b. p.)
2 年	A15204	1. 5700	1. 5700	+0. 00
5 年	A15108	1. 8200	1. 8200	+0. 00
10 年	A15109R	2. 0300	2. 0300	+0. 00
20 年	A15107	2. 1000	2. 1000	+0. 00
30 年	A15201	1. 5980	1. 5980	+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