

2026.08.07

短期利率

昨日央行 NCD 到期 949.50 億元，發行存單 7 天、28 天期 NCD 共 840.50 億元，截至昨日為止央行 NCD 未到期餘額為 64,115.00 億元。

隨著台股回暖收復季線，融資也逐步增加，帶動券商發行需求，使短率持穩區間高位。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 2,025.50 億元。預計發行量例行性擴大，短率成交於區間高位。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

115/8/7	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

2026.08.07

公債交易

台灣 7 月 CPI 年增 2.54%，核心 CPI 年增 2.38%，主因燃油價格推升交通費用加上外食、房租、電腦設備等費用續漲。週四盤面十年券在交易商嘗試放空來給今日標債一些指引，收盤前成交一支在 2.0%。

國外方面，金融時報報導聯準會主席沃什可能在通膨維持高檔的情境下支持 9 月升息，加上市場關注 Alphabet 啟動 250 億美元的公司債發行使殖利率曲線全線上移，終場十年公債殖利率收在 4.68%。

附：收盤行情表 (last bid)

年期	指標券種	8 月 5 日	8 月 6 日	漲跌(b. p.)
2 年	A15203	1.5980	1.5980	+0.00
5 年	A15108	1.8300	1.8300	+0.00
10 年	A15106R	1.9300	2.0000	+7.00
20 年	A15107	2.2000	2.2000	+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