

2026.01.02

短期利率

昨日央行 NCD 到期 2,774.50 億元，發行存單 7 天、28 天期 NCD 共 3,550.70 億元，截至昨日為止央行 NCD 未到期餘額為 74,236.50 億元。

年底最後一日，由於需求方多避開落點導致交易冷清，市場資金寬裕的情勢料延續至提存期底。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 1.45%-1.60%。

今日有央行 NCD 到期 1,307.90 元。由於提存期底前的資金落點都盡量避開，預計發票需求偏低，成交利率則持穩不變。預估本日公債 RP 利率成交在 1.15-1.20%，公司債 RP 成交在 1.45%-1.58%。

附：債券附條件交易牌告利率

115/01/02	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

2026.01.02

公債交易

週三台債市場交投冷清，時序接近年底使交投持續低迷，指標券未見成交。

國外方面，上週初領失業金意外降至 19.9 萬人顯示勞動市場仍具韌性，終場十年期公債殖利率上漲 5 bps 至 4.17%。

附：收盤行情表 (last bid)

年期	指標券種	12 月 30 日	12 月 31 日	漲跌(b. p.)
2 年	A14102	1.1630	1.1630	+0.00
5 年	A14108	1.2050	1.2050	+0.00
10 年	A14110	1.3700	1.3700	+0.00
20 年	A14109	1.4260	1.4260	+0.00
30 年	A14111	1.5390	1.5390	+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