

2026.06.09

短期利率

昨日央行 NCD 到期 2,398.00 億元，發行存單 7 天、28 天期 NCD 共 1,427.00 億元，截至昨日為止央行 NCD 未到期餘額為 66,208.60 億元。

台股崩跌並未見資金明顯回流貨幣市場，資金依舊緊俏，大行同步調高拆款利率，帶動短率區間上移。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 2,266.50 元。預計銀行資金供給量能降溫，使短票利率持續趨升，留意信用卡申報稅款上繳國庫後資金態勢。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%-1.60%。

附：債券附條件交易牌告利率

115/6/9	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

2026.06.09

公債交易

目前台債市場在資金緊俏及美債利率走揚的影響下，整體氣氛偏空，加上 5 月 CPI 突破 2% 警戒線市場擔憂央行將會進行升息，昨日尾盤指標十年券成交至 1.78%，較前日上揚 5bps。

國外方面，以色列與伊朗再度交火，一度刺激油價上漲使市場對通膨的擔憂再起，加上上週非農就業數據優於預期，投資人重新訂價 FED 今年可能的利率路徑，年底前升息的預期推升美債殖利率走揚。之後隨川普呼籲停火及伊朗釋出可能結束對以色列的軍事行動下，利率回吐部分漲幅，終場十年期美債上揚 3.19bps 收在 4.5622%。

附：收盤行情表 (last bid)

年期	指標券種	6 月 5 日	6 月 8 日	漲跌(b. p.)
2 年	A15202	1.4900	1.4900	+0.00
5 年	A15101	1.3850	1.3850	+0.00
10 年	A15106	1.7300	1.7800	+5.00
20 年	A15104	1.5850	1.5850	+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