

2026.07.02

短期利率

昨日央行 NCD 到期 2,530.00 億元，發行存單 7 天、28 天期 NCD 共 1,858.00 億元，截至昨日為止央行 NCD 未到期餘額為 63,435.90 億元。

短票區間高位比重下滑，銀行恢復正常供應，有些原本拆借不到的資金集中到昨日承做，對象則多為銀行，票券商偏少。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 1,944.40 元。民間法人資金充裕買票意願高，預計減少銀行端到期續做的額度，成交利率則微降。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

115/7/2	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

2026.07.02

公債交易

週三受美債殖利率彈升之際買盤縮手觀望，指標券盤面未見成交。

國外方面，美國 6 月 ISM 製造業 PMI 指數降至 53.3 低於市場預期，新訂單指數降至 56 顯示接單需求穩見，不過預防性補貨已有所降溫，價格指數降至 73，供應鏈壓力小幅緩解。6 月 ADP 新增就業人數降至 9.8 萬人但仍為一年來相對高水平，勞動市場維持穩健。聯準會主席沃什表示近期通膨風險下降並再次重申將通膨拉回 2% 的決心，同時表示不會就未來利率政策提供前瞻式指引，終場十年期公債殖利率收在 4.48%。

附：收盤行情表 (last bid)

年期	指標券種	6 月 30 日	7 月 1 日	漲跌(b. p.)
2 年	A15203R	1.5555	1.5555	+0.00
5 年	A15101	1.5800	1.5800	+0.00
10 年	A15106R	1.7000	1.7000	+0.00
20 年	A15107	1.5850	1.5850	+0.00
30 年	A15201	1.5980	1.5980	+0.00