2026.10.02

短期利率

昨日央行 NCD 到期 1,569.50 億元，發行存單 7 天、28 天期 NCD 共 2,871.00 億元，截至昨日為止央行 NCD 未到期餘額為 62,261.00 億元。

時序邁入月初，市場資金需求減少，交投較季底轉趨冷清，而銀行間短錢持續充沛，開出的報價利率水平仍大致持平。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。季底一過資金供給更顯充沛，但發票量預計降溫，帶動短票利率小幅區間偏跌。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

115/10/2	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

2026.10.02

公債交易

台灣 9 月製造業 PMI 升至 63.4，創 2021 年 8 月以來最快擴張速度，台債電子盤連續 22 個交易日未見成交，處所短端 3 年冷券利率成交至 1.849%，長券相對持穩，近 26 年的舊券成交至 2.165%。

國外方面，美國 ISM 製造業 PMI 降至 54.5，其中價格指數升至 77.9，新訂單指數升至 55.3，就業指數升至 52.7 均高於預期，初領失業金人數降至 19.7 萬人。美債在經過連日拋售後出現技術性反彈，且聯準會官員談話偏鴿，副主席 Jefferson 及 Bowman 均表示需要更多時間評估後續政策，終場十年公債收在 5.24%。

附：收盤行情表 (last bid)

年期	指標券種	9 月 30 日	10 月 01 日	漲跌(b. p.)
2 年	A15204	1. 7200	1. 7200	+0. 00
5 年	A15108	1. 8200	1. 8200	+0. 00
10 年	A15109	1. 9000	1. 9000	+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