

2026.06.05

## 短期利率

昨日央行 NCD 到期 2,371.10 億元，發行存單 7 天、28 天及 364 天期 NCD 共 2,986.40 億元，截至昨日為止央行 NCD 未到期餘額為 67,645.10 億元。

市場發行量持續吸收資金，使短率往高位成交。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 2,668.00 元。股市熱度不減，預估短率易上難下。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

115/6/5	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%

2026.06.05

## 公債交易

週三電子盤指標十年券維持平盤在 1.73%，不過長端 30 年券利率基本保持在 1.8875%，整條利率曲線延續走平趨勢。

國外方面，美國初領失業金人數升至 22.5 萬人高於市場預期，且聯準會官員 Barkin 稱勞動市場未見重新轉熱，Daly 也指出目前政策處良好位置，利率前景仍需視數據決定，讓短端利率預期偏鴿，曲線走牛市陡峭化，終場十年期公債收在 4.47%。

### 附：收盤行情表 (last bid)

年期	指標券種	6 月 3 日	6 月 4 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	1.7300	+0.00
20 年	A15104	1.5850	1.5850	+0.00
30 年	A15201	1.5980	1.5980	+0.00