2026.10.01

短期利率

昨日央行 NCD 到期 2,009.00 億元，發行存單 7 天、28 天期 NCD 共 4,007.00 億元，截至昨日為止央行 NCD 未到期餘額為 60,959.50 億元。

儘管央行增發逾 2000 億台幣定存單，中止連 16 日大砍，但季底最後交易日資金供給依舊充裕，短率也持穩原區間。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 1,569.50。跨入月初，預計外商銀行資金回籠，買票的意願也高，引領短票利率持穩原區間。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

115/10/1	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

2026.10.01

公債交易

在十年美債站上 5%且市場擔憂 12 月仍有升息可能之下盤面 9 月之交易日未見成交。

國外方面，美債殖利率全面走高，且長天期升幅較大，曲線呈現熊市陡峭化。核心 PCE 月增 0.2%/年增 3%低於市場預期，個人消費支出月增率升至 0.9%符合市場預期。9 月 ADP 新增就業人數回升至 9 萬人明顯高於市場預期，第二季 GDP 年化季增率上調至 2.2%。終場十年公債殖利率收在 5.28%。

附：收盤行情表 (last bid)

年期	指標券種	9 月 29 日	9 月 30 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