2026.09.07

短期利率

上週寬鬆因素有央行存單到期共 11,517.00 億元，緊縮因素有央行存單發行共 12,665.00 億元，共增加發行 1,148.00 億元。上週跨入新提存期，銀行間拆借資金不算太好找，大多開出負數，使不少銀行操作心態保守，新錢難覓，但整體短率大致持平。30 天期自保票利率成交在 1.65%-1.66%，隔拆加權平均利率收在 0.822%，公司債 RP 利率成交在 1.43%-1.60%。

本週寬鬆因素有央行存單到期共 12,306.70 億元，緊縮因素有中信銀金融債發行共 104.00 億元。預計資金平穩偏多，市況平穩，月內短票尚且不多，短率大致持平。預估本週隔夜拆款成交利率在 0.80%-0.85%，公司債 RP 利率成交在 1.43%-1.60%。

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

2026.09.07

公債交易

台債市場交投轉趨清淡，在五年券標售後進入標債空窗期，加上本月將迎來央行理監事會議，市場對台灣是否會升息想法分歧，在沒有方向指引下各方交投意願不高，上週五指標五年及十年券均無成交。

國外方面，美國 8 月非農就業新增人數 16.2 萬人，大幅優於市場預期的 5.6 萬人，且 7 月數字從原先減少 2.3 萬人上修為增加 2.1 萬人，失業率維持於 4.1%，顯示勞動市場依舊強勁，市場押注 9 月 FED 升息機率上升，美債殖利率全線走升，終場十年期美債上揚 1.41bps 收在 4.7821%。

附：收盤行情表 (last bid)

年期	指標券種	9 月 3 日	9 月 4 日	漲跌(b. p.)
2 年	A15203	1. 7200	1. 7200	+0. 00
5 年	A15108	1. 8200	1. 8200	+0. 00
10 年	A15106	1. 9000	1. 9000	+0. 00
20 年	A15107	2. 2000	2. 2000	+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