

2026.05.28

## 短期利率

昨日央行 NCD 到期 3,021.00 億元，發行存單 7 天、28 天期 NCD 共 2,595.50 億元，截至昨日為止央行 NCD 未到期餘額為 67,566.80 億元。

整體資金更趨緊俏，加上各大票券商發行量擴增，缺口都不小，銀行雖然陸續調整央行存單，但仍有多家民營拆款到期無法續做，利率亦反映市況進一步走高。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 2,549.00 元。時序漸進月底，台股交投熱絡，持續在市場吸金，導致銀行可供應資金更短缺，短率持續往上。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%-1.6%。

### 附：債券附條件交易牌告利率

115/5/28	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%

2026.05.28

## 公債交易

週三盤面未見成交，冷券買盤在看到 30 年公債標售後明顯將報價上移。

國外方面，美債在盤中受美伊談判消息來回震盪，且市場等待後續 PCE 數據下令終場十年期公債以 4.48 的平盤作收。

### 附：收盤行情表 (last bid)

年期	指標券種	5 月 26 日	5 月 27 日	漲跌(b. p.)
2 年	A15202	1.4700	1.4700	+0.00
5 年	A15101	1.3850	1.3850	+0.00
10 年	A15106	1.6350	1.6350	+0.00
20 年	A15104	1.5850	1.5850	+0.00
30 年	A15201	1.5980	1.5980	+0.00