2026.09.10

短期利率

昨日央行 NCD 到期 2,743.00 億元，發行存單 7 天、28 天期 NCD 共 2,124.00 億元，截至昨日為止央行 NCD 未到期餘額為 64,585.50 億元。

整體市場資金續呈略偏緊狀態，且分配不均，部分銀行反映市況稍稍拉高利率。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 2,698.50 元。因資金並不充裕，預計部分銀行降低買票力道，到期無法全數續做，利率亦漸漸往區間高位靠攏。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

115/9/10	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

2026.09.10

公債交易

昨日台債市場等殖盤面續無成交，雖然台灣 8 月通膨數據稍低於預期，但為連續第四個月高於 2%，市場對 9 月是否升息仍存有疑慮，各方靜待下週結果出爐，交投意願低迷。

國外方面，中東緊張情勢再度升溫，國際油價持續走高，布蘭特原油突破每桶 100 美元，市場對通膨的擔憂加劇，加上企業債發行量偏大帶來的供給壓力，帶動美債殖利率走揚，雖然財政部將長天期回購上限提高至 60 億美元，但投資人對此規模感到失望，終場十年期美債上揚 5.24bps 收在 4.8406%。

附：收盤行情表 (last bid)

年期	指標券種	9 月 8 日	9 月 9 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