2026.11.09

短期利率

上週寬鬆因素有央行存單到期共 13,794.50 億元，緊縮因素有央行存單發行共 14,020.50 億元，共增加發行 226.00 億元。跨入新提存期，整體市場資金續偏多，雖受台股重挫影響，使票商措手不及，紛紛轉手向銀行拆款，意外帶動新增需求，利率則無太大變化。30 天期自保票利率成交在 1.67%-1.68%，隔拆加權平均利率收在 0.812%，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 15,115.00 億元，緊縮因素有中油公司債、鴻海公司債、遠鼎公司債、華泰銀金融債及台積電公司債發行共 402.50 億元。預估銀行體系資金仍充裕，到期大多可續做，外商銀行買票意願更高，另需觀察台股是否持續崩跌對貨幣市場資金影響程度。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

2026.11.09

公債交易

週五電子盤未見成交，雖然股市重挫但市場對後續央行會議前景不明下追價動力不佳。

國外方面，10 月非農新增就業人數加速至 16.5 萬人超過市場預期，8、9 月就業數據合計上修 8.4 萬人，且失業率則降至 4.1%，數據公布後強化市場對 12 月升息的押注，終場十年公債殖利率收在 4.86%。

附：收盤行情表 (last bid)

年期	指標券種	11 月 5 日	11 月 6 日	漲跌(b. p.)
2 年	A15204	1. 5500	1. 5500	+0. 00
5 年	A15108	1. 8200	1. 8200	+0. 00
10 年	A15109R	2. 0300	2. 0300	+0. 00
20 年	A15107	2. 1000	2. 1000	+0. 00
30 年	A15110	2. 2670	2. 2670	+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