

2026.09.01

短期利率

昨日央行 NCD 到期 2,222.50 億元，發行存單 7 天、28 天期 NCD 共 2,796.50 億元，截至昨日為止央行 NCD 未到期餘額為 65,378.70 億元。

昨日月底最後交易日，雖有些例行性需求出現，不過在市場資金仍然充裕下，並未受到影響，RP 利率仍是成交在區間內。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 1,485.50 元。月初資金將回流市場，整體市場資金可望維持寬鬆，預期短期利率將持平在區間內。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

115/9/01	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

2026.09.01

公債交易

週一台債交投冷清，市場等待週二五年券開標結果，電子盤未見成交。

國外方面，美伊衝突推升油價後中長端美債再度走弱，市場擔憂能源成本再度傳導到通膨進一步強化對 9 月升息的押注，終場十年公債殖利率收在 4.75%。

附：收盤行情表 (last bid)

年期	指標券種	8 月 28 日	8 月 31 日	漲跌(b. p.)
2 年	A15203	1.7200	1.7200	+0.00
5 年	A15108	1.7900	1.7900	+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