2026.10.16

短期利率

昨日央行 NCD 到期 3,112.00 億元，發行存單 7 天、28 天期 NCD 共 2,392.00 億元，截至昨日為止央行 NCD 未到期餘額為 58,239.00 億元。

外資大賣超台股，匯出超過 3000 億使台幣大貶，惟貨幣市場資金並無受到大幅度影響跡象，短率成交於區間內。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 1,854.00。預計市場資金持平，部份投信有新錢，整體偏小多，短率持平。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

115/10/16	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

2026.10.16

公債交易

週四隨科技股回落之際，避險情緒帶動國際債市殖利率從高點回落，盤面十年券下跌 3 bps 至 2.02%，不過在未來利率政策前景不明之下買盤並未積極追價。

國外方面，美國 9 月 PPI 月增 1.3%，年增 6.3%，月增幅創 2022 年 3 月以來最高，且核心 PPI 年增達 5%均顯示通膨壓力升溫，儘管 9 月 PPI 高於預期，AI 相關股票的波動引發避險買盤回流債市，終場十年公債殖利率收在 5.06%。

附：收盤行情表 (last bid)

年期	指標券種	10 月 14 日	10 月 15 日	漲跌(b. p.)
2 年	A15204	1. 6500	1. 6500	+0. 00
5 年	A15108	1. 8200	1. 8200	+0. 00
10 年	A15109	2. 0500	2. 0200	-3. 00
20 年	A15107	2. 1000	2. 1000	+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