

2026.10.07

短期利率

昨日央行 NCD 到期 6,093.00 億元，發行存單 7 天、28 天、364 天期 NCD 共 4,356.00 億元，截至昨日為止央行 NCD 未到期餘額為 60,917.00 億元。

今日雖到期大量定存單，惟銀行以申購為優先選項，且不少仍有回補積數需求，令拆款熱度不減，成交利率往區間高位靠攏。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 4,047.50。預計行庫資金不算寬裕，放款需求強，且本周短票發行落點較為集中，使得短票成交利率居高不下。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

115/10/7	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

2026.10.07

公債交易

昨日台債市場等殖盤面為連續第 25 個交易日無成交，國際油價持續於高檔震盪，全球債市普遍疲軟，各方交投意願均不高，關注今日 9 月 CPI 的公布。

國外方面，中東原油出口增加，油價走跌稍稍緩解通膨壓力，歐債殖利率自高點回落，也支撐早盤美債走強，三年期公債標售需求尚屬穩健，然而尾盤油價反彈限縮了長債的上漲空間，終場十年期美債下跌 2.53bps 收在 5.2793%。

附：收盤行情表 (last bid)

年期	指標券種	10 月 5 日	10 月 6 日	漲跌(b. p.)
2 年	A15204	1.7200	1.7200	+0.00
5 年	A15108	1.8200	1.8200	+0.00
10 年	A15109	1.9000	1.9000	+0.00
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