

2026.10.27

短期利率

上週寬鬆因素有央行存單到期共 8,296.50 億元，緊縮因素有央行存單發行共 8,345.50 億元，共增加發行 49.00 億元。薔琵颱風來襲，上週五金融市場休市一天，銀行間多已預留帳上資金以應不時之需，市況仍屬充裕，即便有新增調度需求，也很容易滿足。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 0.810%，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 12,073.50 億元，緊縮因素有上海金融債發行 30.00 億元。時序鄰近月底，短票到期量原本就大，加上颱風來襲休市一天，客戶資金落點累加在一起，預計拆款者眾交投熱絡，利率成交於區間內。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%。

2026.10.27

公債交易

週四交易員因擔憂颱風來襲令市場休市而選擇退場觀望，電子盤未見成交。

國外方面，2 年期公債標售結果略遜預期，得標利率高於發行前水準且間接投標人獲配降至 45.7%創近五年新低，市場在聯準會利率決議前對標售結果反應有限，終場十年期公債收在 4.99%。

附：收盤行情表 (last bid)

年期	指標券種	10 月 21 日	10 月 22 日	漲跌(b. p.)
2 年	A15204	1.5700	1.5700	+0.00
5 年	A15108	1.8200	1.8200	+0.00
10 年	A15109	2.0010	2.0010	+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