1. 上週市場行情資訊分析：

上周寬鬆因素為央行存單屆期1兆662億元，緊縮因素則為央行例行性沖銷。上周繳稅季的緊縮餘威及端午節長周末因素，使得市場資金仍然緊俏，短票利率大幅跳升約10基點，不過在央行調節減發存單，幾家大型行庫也出手相援後，逐緩解票券商的資金需求， 30天期自保票上交易日平均利率0.438%，創逾16個月新高。30天期票券次級利率成交在0.40%-0.60%，拆款利率則成交在0.28%~0.50%區間。匯率方面，上周國際美元表現強勁，新台幣兌美元15日在歐元重挫、推升美元指數之下，連續7個交易日收貶，並貶破30元整數大關，終場收在30.002元、貶值6.4分，也是繼5月30日之後，新台幣收盤再度見到「3字頭」，創逾半個月收盤新低價，台北外匯經紀公司成交量12.66億美元，全週成交區間落於29.848~30.002。

1. 本週資金情勢及利率走勢

本周寬鬆因素為央行存單屆期1兆2,345.7億元，緊縮因素則為央行例行性沖銷。本周進入6月下半，季底效應逐步發酵之下，預期市場利率理當延續趨升之勢不變，銀行因季底仍有衝刺放款的緊縮因素，本周的資金情勢仍然不明，資金需求方多觀望銀行當日準備與外匯市場變化，期望儘早出現舒緩季底調度壓力之契機。交易部操作上，將以優先尋覓跨季客戶資金成交，並及早軋平資金為主，規避本月季底調度風險。匯率方面，展望新台幣後市，美國聯準會上週利率決策會議如期升息，並釋出鷹派訊號，國際美元走高，新台幣對美元匯率連帶走弱，加上美國經濟表現不錯，升息效應會維持一段時間，預期本周主要交易區間落在29.95~30.15間波動。

本周寬鬆因素:

1. 央行存單屆期分別為：

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| 日期 | 原因 | 金額(單位:億元) |
| 6/19 | 央行NCD到期 | 4,732.00 |
| 6/20 | 央行NCD到期 | 1,388.40 |
| 6/21 | 央行NCD到期 | 4,188.00 |
| 6/22 | 央行NCD到期 | 2,037.30 |
| 合計 |  | 12,345.70 |

本周緊縮因素：

1. 央行例行性沖銷。