一、上週市場行情資訊分析：

上周寬鬆因素為央行存單屆期2兆544.5億元，緊縮因素則為央行例行性沖銷。上週市場資金偏鬆，銀行體系去化資金的需求增加，拆款和買票交易增溫；龍頭銀行調降拆款利率報價1基點，短票利率則大致持平。上周30天票券次級利率成交在0.30%~0.38%區間，拆款利率則成交在0.25%~0.37%區間。匯率方面，聯準會（Fed）恐推遲升息的步伐，惟歐洲央行（ECB）決策官員擔憂歐元表現過強，加上恐怖攻擊事件影響，市場避險情緒再度升高，致美元走勢偏強，新台幣呈震盪偏弱格局，成交區間落於30.2~30.4。

二、本週資金情勢及利率走勢

本周寬鬆因素為央行存單屆期1兆1,302.35億元，緊縮因素則為央行例行性沖銷。觀察本月並非季底，行庫間操作限制較少，銀行體系資金寬鬆下，部分銀行已有提前開出跨月資金以供調度，預期市場短率將繼續持穩。交易部操作上，將尋覓跨月便宜資金優先成交，並予平均分散落點。匯率方面，受恐怖攻擊事件影響，預期市場避險氣氛持續發酵，美元將呈續強格局，新台幣兌美元成交區間落於30.2~30.5。

本周寬鬆因素:

一、央行存單屆期分別為：

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| 日期 | 原因 | 金額(單位:億元) |
| 8/21 | 央行NCD到期 | 863.00 |
| 8/22 | 央行NCD到期 | 944.60 |
| 8/23 | 央行NCD到期 | 3,581.00 |
| 8/24 | 央行NCD到期 | 2,872.00 |
| 8/25 | 央行NCD到期 | 3,041.75 |
| 合計 |  | 11,302.35 |

本周緊縮因素：

1. 央行例行性沖銷。