一、上週市場行情資訊分析：

上周寬鬆因素為央行存單屆期9,358.5億元，緊縮因素則為央行例行性沖銷。上周周初由於美國聯準會升息在即，外資資金陸續匯出操作下，影響整體市場新台幣資金水位下滑，銀行體系資金分配不均，銀行累計準備負數一度呈現擴大，加上大型金融機構暫停入市釋金，龍頭銀行上調拆出報價，均令市場資金更趨緊俏，短率呈現走升趨勢，集保結算所統計30天自保票平均利率來到近九周高點。上周30天票券次級利率成交0.30%~0.41%區間，拆款利率則成交在0.25%~0.40%區間。匯率方面，上周受到美國聯準會升息影響，外資陸續匯出，促使新台幣匯價表現趨貶，不僅創下連續9個交易日走貶之今年以來最長貶勢，上週五收盤亦創近2個月新低，上周全周新台幣兌美元成交區間落於30.115~30.429。

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2兆665億元，緊縮因素則為央行例行性沖銷。統計本周央行存單到期量大於上周，且金額逾2兆元，加上上周五央行減發存單565.5億元，挹注市場相對偏寬力道，唯本月適逢季底，影響大部分銀行調度保守，加上近期新台幣表現弱勢，外資資金偏向匯出操作，亦促使整體市場流動性變差，預期本周進入6月下半，短率仍有向上走升機會。交易部操作上，將優先尋覓長天期客戶跨季資金成交，藉以規避本月季底調度風險。匯率方面，由於上周美國聯準會預告今年將縮減資產負債表，資金行情受到壓抑，加上台美利差擴大，外資匯出潮湧現，預估短線新台幣兌美元匯價仍難脫離弱勢盤局，成交區間落於30.15~30.65。

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) |
| 6/19 | 央行NCD到期 | 5,192.00 |
| 6/20 | 央行NCD到期 | 2,449.50 |
| 6/21 | 央行NCD到期 | 1,063.00 |
| 6/22 | 央行NCD到期 | 9,207.50 |
| 6/23 | 央行NCD到期 | 2,753.00 |
| 合計 |  | 20,665.00 |

本周緊縮因素：

1. 央行例行性沖銷。