一、上週市場行情資訊分析：

上周寬鬆因素為央行存單屆期1兆4,548億元，緊縮因素則為央行例行性沖銷。上周因綜所稅繳庫效應發酵，銀行資金操作轉趨保守，使得整體市況緊縮，短率因而上揚。上周30天票券次級利率成交0.30%~0.38%區間，拆款利率則成交在0.20%~0.36%區間。匯率方面，受英國國會選舉、美國前FBI局長將赴國會作證等因素影響，市場避險情緒升溫，新台幣兌美元狹幅整理，成交區間落於30.04~30.13。

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9,358.5億元，緊縮因素則為央行例行性沖銷。進入月中，觀察市場資金因綜所稅款上繳因素轉緊縮，所幸央行上周大砍14天存單調控市況，適度調節了市場資金緊縮的態勢，惟本月後續尚有季底例行性緊縮因素，短率恐仍有向上墊高之虞。交易部操作上，交易部操作上，將優先承作跨季客戶長天期資金，藉以規避稅款繳庫以及季底緊縮之調度風險。匯率方面，FOMC升息機會仍高，且國際政治風險升高，避險需求增加，將支撐美元走勢轉強，預期新台幣兌美元仍呈狹幅偏弱盤整格局，成交區間落於30.0~30.4。

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) |
| 6/12 | 央行NCD到期 | 4,085.00 |
| 6/13 | 央行NCD到期 | 2,086.00 |
| 6/14 | 央行NCD到期 | 1,249.50 |
| 6/15 | 央行NCD到期 | 1,728.00 |
| 6/16 | 央行NCD到期 | 210.00 |
| 合計 |  | 9,358.50 |

本周緊縮因素：

1. 央行例行性沖銷。