一、上週市場行情資訊分析：

上周寬鬆因素為央行存單屆期2兆822.5億元，緊縮因素則為央行例行性沖銷。因端午四天連假，加上月底及繳稅等因素，多家銀行均無法提供市場資金，致整體市況呈偏緊縮，短率全面走揚。上周30天票券次級利率成交0.30%~0.35%區間，拆款利率則成交在0.20%~0.35%區間。匯率方面，受FED六月升息機率高、美國總統親俄門政治紛擾、外資匯入趨緩等多空因素交錯，新台幣兌美元呈狹幅盤整，成交區間落於29.9.~30.2。

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9,649.8億元，緊縮因素則為央行例行性沖銷。接近月底、旬底，上周銀行間資金操作保守，大型行庫又停止供應資金，且本周的央行存單屆期量不大，增添了月底旬底資金情勢的不確定性。交易部操作上，除優先收受便宜短錢成交外，亦將適量搭配調入長天期客戶資金跨季，藉以規避季底調度風險。匯率方面，川普減稅與財政政策的不確定性，資金往新興市場與歐洲移動，惟FED6月升息機率高，預期新台幣兌美元呈盤整，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) |
| 5/31 | 央行NCD到期 | 3,679.50 |
| 6/1 | 央行NCD到期 | 2,892.80 |
| 6/2 | 央行NCD到期 | 3,077.50 |
| 6/3 | 央行NCD到期 | 0.00 |
| 合計 |  | 9,649.80 |

本周緊縮因素：

1. 央行例行性沖銷。