一、上週市場行情資訊分析：

上周寬鬆因素為央行存單屆期1兆612.5億元，緊縮因素則為央行例行性沖銷。上周由於外資近期持續匯入，令台幣資金水位上揚，整體市況穩中偏寬，不過部份銀行對跨月資金仍偏保守，短率持穩於近期高檔。30天票券次級利率成交0.30%~0.44%區間，拆款利率則成交在0.24%~0.45%區間。匯率方面，Fed主席葉倫週二於參議院發表樂觀談話，帶動國際美元走強，非美貨幣走弱，惟由於外資持續匯入，新台幣兌美元呈強勢格局，成交區間落在30.7~31.0 。

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1兆706.5億元，緊縮因素則為央行例行性沖銷。進入月底最後一週，雖已有多家銀行提供跨月資金，不過銀行間資金多缺不一的情況仍無改變，加上3月初有公債及國際債交割，預期月底前利率恐仍有變化。交易部操作策略上，將優先承作跨月及跨季資金，及盡早軋平資金缺口為主。匯率方面，近期美國經濟表現穩定，加上Fed將公布會議記錄，預估美元將呈偏強格局，新台幣兌美元成交區間落在30.7~31.1 。

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) |
| 2/20 | 央行NCD到期 | 3,969.00 |
| 2/21 | 央行NCD到期 | 2,145.00 |
| 2/22 | 央行NCD到期 | 2,853.50 |
| 2/23 | 央行NCD到期 | 1,733.00 |
| 2/24 | 央行NCD到期 | 6.00 |
| 合計 |  | 1兆706.50 |

本周緊縮因素：

1. 央行例行性沖銷。