1. 上週市場行情資訊分析：

上週寬鬆因素為央行存單屆期2兆1,356.5億元，緊縮因素則為央行例行性沖銷。上週綜所稅信用卡扣款繳庫，銀行資金水位進一步下降，再加上端午節的長周末積數調節，市場上流動性又趨緊俏，此外本月最後一周的央行存單到期量偏低，在季底前銀行同業心態保守，大型金融機構進一步調高短票利率1個基點，拆款利率則調升2個基點。30天期自保票上交易日平均利率升至0.584%。30天期票券次級利率成交0.48%-0.60%；拆款利率則成交在0.28%~0.59%區間。匯率方面，美中貿易戰升溫，熱錢5月大舉撤出台灣，因匯出力道過猛，甚至還驚動央行，不惜動用外匯存底阻貶新台幣；根據金管會統計淨匯出20.3億美元、折合新台幣約630億元，使得台幣兌美元價格1個月重貶超過7角，貶值達2.2%。但6月開始的交易日接著連續三天收復關卡，周四新台幣兌美元收盤匯率來至31.402元，短短四天就回升0.6%。全週新台幣兌美元成交區間落在31.398~31.53。

1. 本週資金情勢及利率走勢

本週寬鬆因素為央行存單屆期1兆2,000.7億元，緊縮因素則為央行例行性沖銷。統計本週存單到期量不若上週，挹注整體市場資金相對有限，展望本週，銀行間普遍對後續資金情勢缺乏信心，多抱持審慎面對態度，因為本週仍有稅款繳庫，高雄市政債及國庫續借款交割等變數，且季底央行定存單偏少，銀行調度謹慎下，令資金情勢偏緊，市場情況並不樂觀。交易部操作上，由於目前看來市場極缺資金，將以優先軋平資金為主。匯率方面，台幣兌美元歷經5月大幅貶值2.2%後，受到外資轉手匯入及央行介入的影響，6月之初強勢走升，單一周下來就回升0.6%。儘管周四美元指數小幅反彈，台幣沒能站穩31.3元關卡，台幣後市仍看外資動向而定，以目前美國大張旗鼓對各國開戰喊加稅的情況下，有助外資回流新興市場，因此亞幣連同台幣後市可望繼續走升。

本周寬鬆因素:

1. 央行存單屆期分別為：

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| 日期 | 原因 | 金額(單位:億元) |
| 6/10 | 央行NCD到期 | 2,197.50 |
| 6/11 | 央行NCD到期 | 881.00 |
| 6/12 | 央行NCD到期 | 6,123.50 |
| 6/13 | 央行NCD到期 | 2,218.70 |
| 6/14 | 央行NCD到期 | 580.00 |
| 合計 |  | 12,000.70 |

本周緊縮因素：

1. 央行例行性沖銷。