一、上週市場行情資訊分析：

上周寬鬆因素為央行存單屆期1兆1,084億元，緊縮因素則為央行例行性沖銷。進入下旬，但市場資金充裕，外商銀資金水位偏高，行庫仍有消化積數壓力，銀行紛紛拆出跨月資金，短率持穩在既有區間。上周30天票券次級利率成交在0.30%~0.38%區間，拆款利率則成交在0.25%~0.39%區間。匯率方面，受美國參議院通過預算計劃影響，致國際美元反彈，主要亞幣走弱，惟在出口商進場拋匯及外資持續匯入下，新台幣兌美元呈震盪偏弱格局，成交區間落於30.1~30.3。

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1兆2,200.6億元，緊縮因素則為央行例行性沖銷。觀察本月並非季底，行庫間操作限制較少，銀行體系資金寬鬆下，部分銀行已有提前開出跨月資金以供調度，預期市場短率將繼續持穩。交易部操作上，將尋覓跨月便宜資金優先成交，並予平均分散落點。匯率方面，市場關注聯準會(Fed)主席人選，恐影響外資動向，預期新台幣仍維持區間震盪，兌美元成交區間落於30.0~30.2。

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) |
| 10/23 | 央行NCD到期 | 1,351.00 |
| 10/24 | 央行NCD到期 | 840.50 |
| 10/25 | 央行NCD到期 | 818.00 |
| 10/26 | 央行NCD到期 | 6,669.00 |
| 10/27 | 央行NCD到期 | 2,522.10 |
| 合計 |  | 12,200.60 |

本周緊縮因素：

1. 央行例行性沖銷。