

2021/7/28

交易分析

7/28 債市日評

台債今日無成交。海外市場部分，中國股市傳出美國基金大舉拋售香港和中國資產，擔憂美國可能限制基金在中國和香港的投資。儘管消息未經證實，但市場擔憂情緒蔓延，中國股債匯均下跌，而 HSI 也跌逾 5%，人民幣在岸離岸均跌破 6.5 關卡。美債在亞洲的下午時間受到買盤支撐。經濟數據方面，美國公布七月耐久財訂單增幅僅 0.8% 低於預期，但六月數據也受到上修，此外，消費者信心連續第六個月上升，創疫情以來新高，但美債維持亞洲時段由避險買盤帶動的漲勢，最終十年下滑 4.8bp 在 1.241%。展望後市，今晚凌晨 FOMC 預料對縮減購債暗示言論可能較為溫和。而中國市場連續兩日在亞洲時間主導避險情緒，短線上美債建議退場觀望。

年期 / 券別		量(億)	開盤(%)	最高(%)	最低(%)	收盤(%)	昨收(%)	漲跌(bps)
5Y	A10108	--	--	--	--	--	0.285	--
10Y	A10107R	--	--	--	--	--	0.4020	--

資料來源：OTC

資料來源：KGI 整理

央行利率會議時程

資料來源：各國央行網站

國家	會議日期	目前利率	上次會議	國家	會議日期	目前利率	上次會議
美國	7/29	0.25%	0.25%	韓國	8/26	0.50%	0.50%
歐盟	9/9	-0.50%	-0.50%	日本	9/22	-0.1%	-0.1%
英國	8/5	0.10%	0.10%				