

# 工行金融市场：外币利率市场上周概览

(2022 年 10 月 17 日-10 月 21 日)

## ◆ 外币利率市场上周概览——二级市场

- 美国国债价格较前周下跌，10 年期美国国债收益率较前周上行 19.8BP，上周收于 4.217%。
- 德国国债价格较前周下跌，10 年期德国国债收益率较前周上行 7.1BP，上周收于 2.417%。

表 1：主要国家政府债券收益率变动

美国国债	收盘收益率 (%)	较前周 (BP)	较上月末 (BP)	较去年末 (BP)
2 年	4.472	-2.4	19.4	374.0
5 年	4.341	7.3	25.1	307.8
10 年	4.217	19.8	38.8	270.7
30 年	4.334	34.2	55.8	243.0
德国国债				
2 年	2.041	8.5	28.2	266.1
5 年	2.212	9.8	24.9	266.5
10 年	2.417	7.1	30.9	259.4
30 年	2.442	4.3	35.0	224.5

数据来源：彭博

免责声明：本研究报告由中国工商银行股份有限公司（以下简称“工商银行”）撰写，研究报告所引用信息均来自公开资料，所载观点不代表工商银行立场。我们力求但不保证这些信息的准确性和完整性。对于任何因使用或信赖本晨报信息而造成（或声称造成）的任何直接或间接损失，我们不承担任何责任。本报告版权仅为工商银行所有，未经书面许可，任何机构和个人不得以任何形式翻版、复制、刊登、发表或引用。工商银行保留对任何侵权行为进行追究的权利。

◆ 外币利率市场上周概览——利率掉期市场

- 美元利率掉期率区间震荡，10 年期美元利率掉期率较前周上行 20.90BP，上周收于 4.2304%。

表 2：美元利率掉期率变动

	收盘收益率(%)	较前周 (BP)	较上月末 (BP)	较去年末 (BP)
2 年	4.8668	-0.59	32.08	392.55
10 年	4.2304	20.90	35.34	264.94
30 年	3.8656	34.58	51.16	213.45

数据来源：彭博

免责声明：本研究报告由中国工商银行股份有限公司（以下简称“工商银行”）撰写，研究报告所引用信息均来自公开资料，所载观点不代表工商银行立场。我们力求但不保证这些信息的准确性和完整性。对于任何因使用或信赖本晨报信息而造成（或声称造成）的任何直接或间接损失，我们不承担任何责任。本报告版权仅为工商银行所有，未经书面许可，任何机构和个人不得以任何形式翻版、复制、刊登、发表或引用。工商银行保留对任何侵权行为进行追究的权利。