

工行金融市场：外币利率市场上周概览

(2022 年 7 月 18 日-7 月 22 日)

◆ 外币利率市场上周概览——二级市场

- 美国国债价格较前周上涨。受美国部分经济数据不及预期、市场避险情绪浓厚等因素影响，美国国债收益率震荡下行。截至收盘，10 年期美国国债收益率较前周下行 16.5BP，上周收于 2.750%。
- 德国国债价格较前周上涨。受欧央行加息 50BP、意大利总理德拉吉辞职、欧元区部分数据不及预期等因素影响，德国国债收益率震荡下行。截至收盘，10 年期德国国债收益率较前周下行 10.2BP，上周收于 1.031%。

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	2.970	-15.0	1.7	223.8
5 年	2.843	-19.1	-19.5	158.0
10 年	2.750	-16.5	-26.3	124.0
30 年	2.972	-10.3	-21.1	106.9
德国国债				
2 年	0.453	-1.4	-19.6	107.3
5 年	0.777	-5.5	-29.0	123.0
10 年	1.031	-10.2	-30.5	120.8
30 年	1.285	-7.5	-33.0	108.8

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

- 美元利率掉期率下行，10 年期美元利率掉期率较前周下行 34.73BP，上周收于 2.8254%。

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	3.1940	-19.31	-8.20	225.27
10 年	2.8254	-34.73	-26.84	124.44
30 年	2.7315	-26.23	-21.63	100.04

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。