

工行金融市场：外币利率市场上周概览

(2022 年 8 月 8 日-8 月 12 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。受美国密歇根大学消费者信心指数数据高于预期、市场对新债认购需求疲软等因素影响，美国国债收益率震荡上行。截至收盘，10 年期美国国债收益率较前周上行 0.4BP，上周收于 2.831%。
- 德国国债价格较前周下跌。受欧央行加息预期加强、美国国债收益率震荡上行等因素影响，德国国债收益率震荡上行。截至收盘，10 年期德国国债收益率较前周上行 3.2BP，上周收于 0.987%。

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	3.242	1.7	35.8	251.0
5 年	2.956	0.1	28.0	169.3
10 年	2.831	0.4	18.3	132.1
30 年	3.108	4.2	9.8	120.5
德国国债				
2 年	0.608	13.0	32.7	122.8
5 年	0.755	4.4	22.6	120.8
10 年	0.987	3.2	17.0	116.4
30 年	1.237	6.7	16.5	104.0

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下行 0.81BP，上周收于 2.8832%。

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	3.5519	5.44	39.94	261.06
10 年	2.8832	-0.81	15.76	130.22
30 年	2.8036	2.74	6.93	107.25

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。