

工行金融市场：外币利率市场上周概览

(2022 年 10 月 10 日-10 月 14 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 13.7BP，上周收于 4.018%。
- 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 15.2BP，上周收于 2.346%。

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	4.496	18.8	21.7	376.4
5 年	4.268	12.5	17.8	300.5
10 年	4.018	13.7	19.0	250.8
30 年	3.992	15.0	21.6	208.8
德国国债				
2 年	1.956	9.0	19.7	257.6
5 年	2.114	7.6	15.1	256.7
10 年	2.346	15.2	23.8	252.3
30 年	2.399	26.2	30.7	220.2

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

- 美元利率掉期率整体上行，10 年期美元利率掉期率较前周上行 12.48BP，上周收于 4.0214%。

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	4.8727	23.02	32.67	393.14
10 年	4.0214	12.48	14.44	244.04
30 年	3.5198	11.87	16.58	178.87

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。