

工行金融市场：外币利率市场上周概览

(2022 年 4 月 11 日-4 月 15 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。受美联储鸽派官员转鹰、美国核心零售销售及消费者信心好于预期等因素影响，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 12.8BP，上周收于 2.828%。
- 德国国债价格较前周下跌。受美国国债收益率震荡上行等因素带动，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 13.5BP，上周收于 0.842%。

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	2.454	-5.8	11.9	172.2
5 年	2.787	3.3	32.7	152.4
10 年	2.828	12.8	49.0	131.7
30 年	2.915	19.7	46.7	101.2
德国国债				
2 年	0.047	-0.3	12.1	66.7
5 年	0.574	4.6	19.9	102.7
10 年	0.842	13.5	29.4	101.9
30 年	1.015	20.6	34.9	81.8

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

- 美元利率掉期率上行，10 年期美元利率掉期率较前周上行 11.77BP，上周收于 2.8757%。

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	2.7153	-5.07	16.19	177.40
10 年	2.8757	11.77	46.92	129.47
30 年	2.7205	17.33	46.76	98.94

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。