

工行金融市场：外币利率市场上周概览

(2021年4月12日-4月16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，主要受美俄冲突抬升避险情绪、市场对疫情防控前景担忧等因素影响，截至收盘，10年期美国国债收益率较前周下跌7.9BP，上周收于1.580%。
- 德国国债价格较前周下跌，主要受欧洲股市均呈现不同幅度走高态势、投资者风险偏好回升等因素影响，截至收盘，10年期德国国债收益率较前周上涨4.1BP，上周收于-0.262%。

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	0.161	0.6	0.1	4.0
5年	0.831	-3.2	-10.9	47.0
10年	1.580	-7.9	-16.1	66.7
30年	2.265	-6.4	-14.6	62.0
德国国债				
2年	-0.690	1.2	0.1	1.0
5年	-0.607	2.6	2.1	13.1
10年	-0.262	4.1	3.0	30.7
30年	0.295	5.3	3.7	45.3

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跌12.17BP，上周收于1.5664%。

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	0.2789	-0.22	-1.26	8.11
10 年	1.5664	-12.17	-21.53	64.11
30 年	1.9913	-12.26	-20.77	58.93

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。