

工行金融市场：外币利率市场上周概览

(2022年4月25日-4月29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。受美国劳动力市场数据向好、美联储加息缩表预期升温等因素影响，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3.5BP，上周收于2.934%。
- 德国国债价格较前周上涨。受俄罗斯切断向波兰和保加利亚供气、德国政府下调2022年GDP预测等因素影响，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3.4BP，上周收于0.938%。

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	2.715	4.7	38.0	198.2
5年	2.955	2.3	49.5	169.2
10年	2.934	3.5	59.6	142.4
30年	2.997	5.3	55.0	109.4
德国国债				
2年	0.261	-2.2	33.5	88.1
5年	0.677	-7.5	30.2	113.0
10年	0.938	-3.4	39.0	111.5
30年	1.091	2.2	42.5	89.4

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7.19BP，上周收于3.0237%。

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	3.0465	8.50	49.31	210.52
10年	3.0237	7.19	61.72	144.27
30年	2.7853	6.16	53.24	105.42

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。