

工行金融市场：外币利率市场上周概览

(2022年5月9日-5月13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。主要受高通胀及欧美股市大跌刺激市场避险情绪、投资者对美国财政部标售国债需求旺盛等因素影响，美国国债收益率明显下行。截至收盘，10年期美国国债收益率较前周下行20.8BP，上周收于2.919%。
- 德国国债价格较前周上涨。主要受市场对欧洲经济发展前景较为悲观、欧洲股票市场整体下跌等因素影响，德国国债收益率明显下行。截至收盘，10年期德国国债收益率较前周下行18.4BP，上周收于0.948%。

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	2.578	-15.3	-13.7	184.6
5年	2.866	-21.2	-8.9	160.3
10年	2.919	-20.8	-1.5	140.8
30年	3.079	-14.7	8.1	117.5
德国国债				
2年	0.106	-21.4	-15.5	72.6
5年	0.599	-25.2	-7.8	105.2
10年	0.948	-18.4	1.0	112.5
30年	1.123	-11.8	3.2	92.6

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下行，10年期美元利率掉期率较前周下行19.70BP，上周收于2.9980%。

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	2.8735	-18.13	-17.30	193.22
10年	2.9980	-19.70	-2.57	141.70
30年	2.8469	-12.13	6.16	111.58

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。