

工行金融市场：外币利率市场上周概览

(2022年6月20日-6月24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。主要受美国6月PMI数据降幅超市场预期、市场对经济前景的担忧加剧等因素影响，美国国债收益率有所下行。截至收盘，10年期美国国债收益率较前周下行9.5BP，上周收于3.130%。
- 德国国债价格较前周上涨。主要受德国和法国6月PMI数据均不及预期、欧央行官员表示2023年欧元区或陷入经济负增长等因素影响，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21.9BP，上周收于1.442%。

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	3.063	-11.5	50.7	233.1
5年	3.186	-15.6	36.8	192.3
10年	3.130	-9.5	28.6	162.0
30年	3.257	-2.2	21.2	135.4
德国国债				
2年	0.813	-28.1	31.0	143.3
5年	1.163	-29.4	32.9	161.6
10年	1.442	-21.9	32.0	161.9
30年	1.691	-16.0	31.2	149.4

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

- 美元利率掉期率区间震荡，10年期美元利率掉期率较前周下行7.43BP，上周收于3.2163%。

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	3.4039	-19.61	50.99	246.26
10年	3.2163	-7.43	28.63	163.53
30年	3.0252	2.44	18.90	129.41

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。