

工行金融市场：外币利率市场上周概览

(2022年7月4日-7月8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。受美联储最新会议纪要凸显遏制通胀决心、美国就业数据强于预期等因素影响，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20.0BP，上周收于3.080%。
- 德国国债价格较前周下跌。受高通胀持续拖累欧洲经济、欧央行加息预期等因素影响，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11.3BP，上周收于1.345%。

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	3.105	27.2	15.1	237.3
5年	3.123	24.6	8.6	186.0
10年	3.080	20.0	6.7	157.0
30年	3.244	14.1	6.1	134.0
德国国债				
2年	0.527	1.1	-12.2	114.7
5年	0.966	3.8	-10.1	141.9
10年	1.345	11.3	0.9	152.2
30年	1.609	4.5	-0.6	141.2

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20.93BP，上周收于3.1727%。

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	3.3871	26.02	11.11	244.58
10年	3.1727	20.93	7.89	159.17
30年	2.9938	12.22	4.60	126.27

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。