

工行金融市场：外币利率市场上周概览

(2022年7月11日-7月15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。主要受美国通胀续创逾四十年新高、市场避险情绪浓厚等因素影响，美国国债收益率震荡下行。截至收盘，10年期美国国债收益率较前周下行16.5BP，上周收于2.952%。
- 德国国债价格较前周上涨。主要受德国7月经济景气数据大幅不及预期、英国政局动荡等因素影响，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21.2BP，上周收于1.133%。

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	3.120	1.5	16.7	238.8
5年	3.034	-8.9	-0.4	177.1
10年	2.915	-16.5	-9.8	140.5
30年	3.075	-16.9	-10.8	117.2
德国国债				
2年	0.467	-6.0	-18.2	108.7
5年	0.832	-13.4	-23.5	128.5
10年	1.133	-21.2	-20.3	131.0
30年	1.360	-24.9	-25.5	116.3

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

- 美元利率掉期率震荡下行，10年期美元利率掉期率较前周下行18.09BP，上周收于2.9918%。

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	3.3880	0.09	11.20	244.67
10年	2.9918	-18.09	-10.20	141.08
30年	2.8149	-17.89	-13.29	108.38

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。