

工行金融市场：外币利率市场上周概览

(2022年3月14日-3月18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，主要受美国通胀压力高企、美联储如期加息并表示可能加快收紧速度等因素影响，截至收盘，10年期美国国债收益率较前周上行15.8BP，上周收于2.149%。
- 德国国债价格较前周下跌，主要受俄乌谈判释放妥协信号提振市场风险偏好、欧洲主要股指上涨、美债收益率上行带动因素影响，截至收盘，10年期德国国债收益率较前周上行12.4BP，上周收于0.373%。

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	1.936	18.8	50.4	120.4
5年	2.143	19.7	42.5	88.0
10年	2.149	15.8	32.4	63.9
30年	2.420	6.7	25.9	51.7
德国国债				
2年	-0.338	6.9	19.3	28.2
5年	0.090	10.0	25.0	54.3
10年	0.373	12.4	23.8	55.0
30年	0.561	14.9	14.5	36.4

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

- 美元利率掉期率震荡上行，10年期美元利率掉期率较前周上行18.27BP，上周收于2.2629%。

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	2.2008	24.20	59.74	125.95
10 年	2.2629	18.27	34.67	68.19
30 年	2.2530	17.01	30.17	52.19

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。