

工行金融市场：外币利率市场上周概览

(2022年5月23日-5月27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。主要受美国总统拜登考虑降低或取消对中国加征的关税、美国经济数据好坏参半等因素影响，美国国债收益率小幅下行。截至收盘，10年期美国国债收益率较前周下行4.3BP，上周收于2.738%。
- 德国国债价格较前周下跌。主要受欧洲央行行长拉加德称可能很快开始加息、欧洲股市整体上涨等因素影响，德国国债收益率小幅上行。截至收盘，10年期德国国债收益率较前周上行1.9BP，上周收于0.963%。

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	2.476	-10.5	-23.9	174.4
5年	2.718	-8.2	-23.7	145.5
10年	2.738	-4.3	-19.6	122.8
30年	2.964	-2.3	-3.4	106.0
德国国债				
2年	0.353	1.1	9.2	97.3
5年	0.660	0.5	-1.7	111.3
10年	0.963	1.9	2.5	114.0
30年	1.246	13.0	15.5	104.9

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

- 美元利率掉期率小幅震荡，10年期美元利率掉期率较前周下行 2.43BP，上周收于 2.8182%。

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	2.8084	-6.16	-23.81	186.71
10 年	2.8182	-2.43	-20.55	123.72
30 年	2.7445	2.62	-4.08	101.34

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。