

工行金融市场：外币利率市场上周概览

(2020年8月10日-8月14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，主要受美国股市持续上涨、7月CPI数据高于预期、美国大面积发行新债带动供给增加等因素影响，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涨14.5BP，上周收于0.709%。
- 德国国债价格较前周下跌，主要受欧洲股市继续上扬、美国决定减少对英国和希腊的征税商品提振市场风险情绪等因素影响，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涨8.8BP，上周收于-0.421%。

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	0.145	1.600	3.960	-142.030
5年	0.2945	6.350	9.010	-137.540
10年	0.7094	14.540	18.120	-116.940
30年	1.4471	21.350	25.460	-88.260
德国国债				
2年	-0.647	3.600	6.600	-4.600
5年	-0.629	6.000	9.200	-15.600
10年	-0.421	8.800	10.300	-23.600
30年	0.019	11.000	12.000	-33.000

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涨，10年期美元利率掉期率较前周上涨约 13.02BP，上周收于 0.7072%。

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	0.2340	2.23	5.52	-146.35
10 年	0.7072	13.02	18.58	-118.78
30 年	1.0510	20.04	28.16	-104.04

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。