

工行金融市场：外币利率市场上周概览

(2022年10月24日-10月28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，10年期美国国债收益率较前周下行20.4BP，上周收于4.012%。
- 德国国债价格较前周上涨，10年期德国国债收益率较前周下行31.4BP，上周收于2.103%。

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	4.414	-5.8	13.6	368.2
5年	4.184	-15.7	9.4	292.1
10年	4.012	-20.4	18.4	250.2
30年	4.141	-19.2	36.6	223.8
德国国债				
2年	1.939	-10.2	18.0	255.9
5年	1.997	-21.5	3.4	245.0
10年	2.103	-31.4	-0.5	228.0
30年	2.078	-36.4	-1.4	188.1

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

- 美元利率掉期率整体下行，10年期美元利率掉期率较前周下行17.99BP，上周收于4.0505%。

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	4.7983	-6.85	25.23	385.70
10年	4.0505	-17.99	17.35	246.95
30年	3.6776	-18.80	32.36	194.65

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。