

工行金融市场：外币利率市场上周概览

(2022年6月27日-7月1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。受市场对美国经济衰退担忧加剧、股市下跌、避险情绪升温等因素影响，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25.0BP，上周收于2.880%。
- 德国国债价格较前周上涨。受欧元区6月通胀数据继续高企、市场对欧元区经济衰退预期增强等因素影响，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21.0BP，上周收于1.232%。

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	2.833	-23.0	-12.0	210.1
5年	2.878	-30.8	-16.0	161.5
10年	2.880	-25.0	-13.3	137.0
30年	3.103	-15.4	-8.0	120.0
德国国债				
2年	0.516	-29.7	-13.3	113.6
5年	0.928	-23.5	-13.9	138.1
10年	1.232	-21.0	-10.4	140.9
30年	1.564	-12.7	-5.1	136.7

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 25.29BP，上周收于 2.9634%。

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	3.1269	-27.70	-14.91	218.56
10 年	2.9634	-25.29	-13.04	138.24
30 年	2.8716	-15.36	-7.62	114.05

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。