

工行金融市场：外币利率市场上周概览

(2022年8月1日-8月5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。受美国7月新增就业持续向好、美联储加息预期提升、市场避险情绪浓厚等因素影响，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行17.8BP，上周收于2.827%。
- 德国国债价格较前周下跌。受欧元区通胀维持高位、英国央行加息50BP、美债收益率上涨带动、欧元区经济衰退的担忧等因素影响，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行13.8BP，上周收于0.955%。

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	3.226	34.1	34.1	249.4
5年	2.956	28.0	28.0	169.3
10年	2.827	17.8	17.8	131.7
30年	3.066	5.6	5.6	116.3
德国国债				
2年	0.478	19.7	19.7	109.8
5年	0.711	18.2	18.2	116.4
10年	0.955	13.8	13.8	113.2
30年	1.170	9.8	9.8	97.3

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16.57BP，上周收于2.8913%。

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	3.4975	34.50	34.50	255.62
10年	2.8913	16.57	16.57	131.03
30年	2.7762	4.19	4.19	104.51

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。