

工行金融市场：外币利率市场上周概览

(2022年8月15日-8月19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。受部分美联储官员再度发表鹰派加息言论等因素影响，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14.1BP，上周收于2.972%。
- 德国国债价格较前周下跌。受德国及英国通胀数据高企等因素影响，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24.3BP，上周收于1.230%。

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 | 3.234 | -0.8 | 34.9 | 250.2 |
| 5年 | 3.093 | 13.7 | 41.7 | 183.0 |
| 10年 | 2.972 | 14.1 | 32.3 | 146.2 |
| 30年 | 3.212 | 10.4 | 20.2 | 130.9 |
| 德国国债 | | | | |
| 2年 | 0.824 | 21.6 | 54.3 | 144.4 |
| 5年 | 1.042 | 28.7 | 51.3 | 149.5 |
| 10年 | 1.230 | 24.3 | 41.3 | 140.7 |
| 30年 | 1.404 | 16.7 | 33.2 | 120.7 |

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上行，10年期美元利率掉期率较前周上行14.62BP，上周收于3.0594%。

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 | 3.5924 | 4.05 | 43.99 | 265.11 |
| 10年 | 3.0294 | 14.62 | 30.38 | 144.84 |
| 30年 | 2.8965 | 9.29 | 16.22 | 116.54 |

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。