

工行金融市场：外币利率市场上周概览

(2022年8月22日-8月26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。主要受美联储多位官员发表鹰派观点、8月密歇根大学消费者信心指数高于预期等因素影响，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6.9BP，上周收于3.041%。
- 德国国债价格较前周下跌。主要受欧洲天然气价格续创新高、德国7月PPI数据大幅高于预期等因素影响，德国国债收益率有所上行。截至收盘，10年期德国国债收益率较前周上行16.0BP，上周收于1.390%。

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	3.397	16.3	51.2	266.4
5年	3.205	11.2	52.9	194.2
10年	3.041	6.9	39.2	153.1
30年	3.192	-2.0	18.2	128.9
德国国债				
2年	0.988	16.4	70.7	160.8
5年	1.181	13.9	65.2	163.4
10年	1.390	16.0	57.3	156.7
30年	1.515	11.1	44.3	131.8

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9.64BP，上周收于3.1258%。

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	3.7310	13.86	57.85	278.97
10年	3.1258	9.64	40.02	154.48
30年	2.9049	0.84	17.06	117.38

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。