

工行金融市场：外币利率市场上周概览

(2022年8月29日-9月2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。受美联储官员鹰派言论持续发酵、美国部分经济数据表现较好等因素影响，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14.9BP，上周收于3.189%。
- 德国国债价格较前周下跌。受市场预期欧央行可能超预期加息、德国和欧元区通胀创新高等因素影响，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13.5BP，上周收于1.525%。

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	3.387	-0.9	-10.6	265.5
5年	3.293	8.8	-5.8	203.0
10年	3.189	14.9	-0.3	167.9
30年	3.344	15.2	5.1	144.0
德国国债				
2年	1.101	11.3	-10.1	172.1
5年	1.308	12.7	-8.3	176.1
10年	1.525	13.5	-1.6	170.2
30年	1.691	17.6	6.4	149.4

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16.20BP，上周收于3.2878%。

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	3.7619	3.09	-8.60	282.06
10年	3.2878	16.20	0.74	170.68
30年	3.0452	14.03	3.19	131.41

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。