

工行金融市场：外币利率市场上周概览

(2023年1月9日-1月13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，10年期美国国债收益率较前周下行5.5BP，上周收于3.504%。
- 德国国债价格较前周上涨，10年期德国国债收益率较前周下行4.2BP，上周收于2.168%。

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	4.232	-1.5	-19.4	-19.4
5年	3.611	-8.7	-39.3	-39.3
10年	3.504	-5.5	-37.1	-37.1
30年	3.610	-7.7	-35.3	-35.3
德国国债				
2年	2.593	1.2	-17.1	-17.1
5年	2.202	-4.9	-37.6	-37.6
10年	2.168	-4.2	-40.3	-40.3
30年	2.134	-2.1	-41.1	-41.1

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2.94BP，上周收于3.4708%。

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	4.4980	-5.58	-21.03	-21.03
10年	3.4708	-2.94	-36.67	-36.67
30年	3.2219	-0.62	-26.91	-26.91

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。