

工行金融市场：外币利率市场上周概览

(2024年4月8日-4月12日)

◆ 外币利率市场上周概览——二级市场

- 美国国债价格下跌，10年期美国国债收益率较前周上行12.0BP，上周收于4.522%。
- 德国国债价格上涨，10年期德国国债收益率较前周下行4.0BP，上周收于2.359%。

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	4.897	14.6	27.7	64.7
5年	4.558	16.6	34.5	71.1
10年	4.522	12.0	32.2	64.3
30年	4.629	7.6	28.6	60.1
德国国债				
2年	2.856	-1.9	0.8	45.2
5年	2.367	-2.3	4.6	41.9
10年	2.359	-4.0	6.1	33.5
30年	2.506	-6.4	5.1	24.3

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11.70BP，上周收于4.1415%。

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	4.8190	16.52	27.35	75.33
10年	4.1415	11.70	30.40	66.75
30年	3.8767	7.46	25.57	56.06

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。