

工行金融市场：外币利率市场上周概览

(2024年4月29日-5月3日)

◆ 外币利率市场上周概览——二级市场

- 美国国债价格上涨，10年期美国国债收益率较前周下行15.5BP，上周收于4.508%。
- 德国国债价格上涨，10年期德国国债收益率较前周下行8.0BP，上周收于2.495%。

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	4.816	-17.7	-21.9	56.6
5年	4.499	-18.8	-21.6	65.2
10年	4.508	-15.5	-17.2	62.9
30年	4.665	-11.1	-11.9	63.7
德国国债				
2年	2.924	-6.4	-11.0	52.0
5年	2.514	-7.2	-10.2	56.6
10年	2.495	-8.0	-8.9	47.1
30年	2.619	-9.0	-7.1	35.6

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

- 美元利率掉期率下行，10年期美元利率掉期率较前周下行16.01BP，上周收于4.1335%。

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	4.7406	-18.17	-22.79	67.49
10 年	4.1335	-16.01	-17.66	65.95
30 年	3.9026	-11.58	-12.56	58.65

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。