

工行金融市场：外币利率市场上周概览

(2024 年 7 月 8 日-7 月 12 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 9.5BP，上周收于 4.183%。
- 德国国债价格上涨，10 年期德国国债收益率较前周下行 6.0BP，上周收于 2.496%。

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	4.451	-15.3	-30.3	20.1
5 年	4.102	-12.3	-27.5	25.5
10 年	4.183	-9.5	-21.3	30.4
30 年	4.396	-8.1	-16.2	36.8
德国国债				
2 年	2.823	-6.6	-1.0	41.9
5 年	2.475	-5.6	-0.7	52.7
10 年	2.496	-6.0	-0.4	47.2
30 年	2.683	-3.5	-0.8	42.0

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 10.85BP，上周收于 3.7471%。

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	4.2835	-17.17	-32.47	21.78
10 年	3.7471	-10.85	-23.19	27.31
30 年	3.6093	-6.47	-14.97	29.32

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。