

工行金融市场：外币利率市场上周概览

(2023 年 9 月 18 日-9 月 22 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 10.1BP，上周收于 4.434%。
- 德国国债价格下跌，10 年期德国国债收益率较前周上行 6.4BP，上周收于 2.739%。

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	5.110	7.7	24.7	68.4
5 年	4.558	9.5	30.4	55.5
10 年	4.434	10.1	32.6	55.9
30 年	4.525	10.7	31.4	56.2
德国国债				
2 年	3.258	4.3	28.0	49.4
5 年	2.750	5.8	27.3	17.2
10 年	2.739	6.4	27.3	16.8
30 年	2.893	7.6	30.2	34.8

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

- 美元利率掉期率整体上行，10 年期美元利率掉期率较前周上行 11.00BP，上周收于 4.1435%。

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	5.0103	7.38	24.34	56.43
10 年	4.1435	11.00	31.61	58.60
30 年	3.8445	11.18	30.35	63.60

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。