

工行金融市场：外币利率市场上周概览

(2023 年 11 月 6 日-11 月 10 日)

◆ 外币利率市场上周概览——二级市场

- 美国国债价格震荡，10 年期美国国债收益率较前周上行 8.0BP，上周收于 4.652%。
- 德国国债价格震荡，10 年期德国国债收益率较前周上行 7.2BP，上周收于 2.717%。

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	5.062	22.3	-2.5	63.6
5 年	4.684	18.0	-17.0	68.0
10 年	4.652	8.0	-27.9	77.7
30 年	4.762	-0.5	-33.1	79.9
德国国债				
2 年	3.066	10.5	5.0	30.2
5 年	2.655	11.3	0.0	7.7
10 年	2.717	7.2	-8.9	14.6
30 年	2.929	1.0	-16.5	38.4

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

- 美元利率掉期率上行，10 年期美元利率掉期率较前周上行 8.20BP，上周收于 4.3018%。

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	4.8921	18.40	-7.68	44.61
10 年	4.3018	8.20	-26.74	74.43
30 年	4.0750	0.53	-30.15	86.65

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。