

工行金融市场：外币利率市场上周概览

(2023年11月13日-11月17日)

◆ 外币利率市场上周概览——二级市场

- 美国国债价格整体上涨，10年期美国国债收益率较前周下行21.7BP，上周收于4.435%。
- 德国国债价格整体上涨，10年期德国国债收益率较前周下行12.9BP，上周收于2.588%。

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 | 4.886 | -17.6 | -20.1 | 46.0 |
| 5年 | 4.441 | -24.3 | -41.3 | 43.7 |
| 10年 | 4.435 | -21.7 | -49.6 | 56.0 |
| 30年 | 4.589 | -17.3 | -50.4 | 62.6 |
| 德国国债 | | | | |
| 2年 | 2.964 | -10.2 | -5.2 | 20.0 |
| 5年 | 2.531 | -12.4 | -12.4 | -4.7 |
| 10年 | 2.588 | -12.9 | -21.8 | 1.7 |
| 30年 | 2.802 | -12.7 | -29.2 | 25.7 |

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下行，10年期美元利率掉期率较前周下行 20.88BP，上周收于 4.0930%。

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 | 4.7050 | -18.71 | -26.39 | 25.90 |
| 10 年 | 4.0930 | -20.88 | -47.62 | 53.55 |
| 30 年 | 3.9174 | -15.76 | -45.91 | 70.89 |

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。