

工行金融市场：外币利率市场上周概览

(2023 年 11 月 20 日-11 月 24 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 3.1BP，上周收于 4.467%。
- 德国国债价格下跌，10 年期德国国债收益率较前周上行 5.5BP，上周收于 2.643%。

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	4.948	6.3	-13.9	52.2
5 年	4.485	4.4	-36.9	48.1
10 年	4.467	3.1	-46.4	59.2
30 年	4.597	0.8	-49.6	63.4
德国国债				
2 年	3.072	10.8	5.6	30.8
5 年	2.616	8.5	-3.9	3.8
10 年	2.643	5.5	-16.3	7.2
30 年	2.819	1.7	-27.5	27.4

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

- 美元利率掉期率整体上行，10 年期美元利率掉期率较前周上行 2.55BP，上周收于 4.1185%。

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	4.7460	4.10	-22.29	30.00
10 年	4.1185	2.55	-45.07	56.10
30 年	3.9330	1.56	-44.35	72.45

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。