

工行金融市场：外币利率市场上周概览

(2024年2月19日-2月23日)

◆ 外币利率市场上周概览——二级市场

- 美国国债价格涨跌互现，10年期美国国债收益率较前周下行3.1BP，上周收于4.248%。
- 德国国债价格涨跌互现，10年期德国国债收益率较前周下行3.9BP，上周收于2.363%。

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	4.690	4.8	48.3	44.0
5年	4.280	0.6	44.5	43.3
10年	4.248	-3.1	33.6	36.9
30年	4.370	-6.5	20.4	34.2
德国国债				
2年	2.853	3.7	42.5	44.9
5年	2.373	-1.7	32.2	42.5
10年	2.363	-3.9	19.7	33.9
30年	2.493	-5.1	8.8	23.0

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

- 美元利率掉期率区间震荡，10年期美元利率掉期率较前周下行4.15BP，上周收于3.8756%。

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	4.5589	4.99	48.74	49.32
10年	3.8756	-4.15	32.69	40.16
30年	3.6494	-5.68	19.44	33.33

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。