

# 工行金融市场：外币利率市场上周概览

(2024年7月1日-7月5日)

## ◆ 外币利率市场上周概览——二级市场

- 美国国债价格上涨，10年期美国国债收益率较前周下行11.8BP，上周收于4.278%。
- 德国国债价格下跌，10年期德国国债收益率较前周上行5.6BP，上周收于2.556%。

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	4.604	-15.0	-15.0	35.4
5年	4.225	-15.2	-15.2	37.8
10年	4.278	-11.8	-11.8	39.9
30年	4.477	-8.1	-8.1	44.9
德国国债				
2年	2.889	5.6	5.6	48.5
5年	2.531	4.9	4.9	58.3
10年	2.556	5.6	5.6	53.2
30年	2.718	2.7	2.7	45.5

数据来源：Bloomberg

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

- 美元利率掉期率震荡下行，10年期美元利率掉期率较前周下行12.34BP，上周收于3.8556%。

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	4.4552	-15.30	-15.30	38.95
10 年	3.8556	-12.34	-12.34	38.16
30 年	3.6740	-8.50	-8.50	35.79

数据来源：Bloomberg

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。