

工行金融市场：外币利率市场上周概览

(2023 年 1 月 23 日-1 月 27 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上行 2.5BP，上周收于 3.504%。
- 德国国债价格较前周下跌，10 年期德国国债收益率较前周上行 6.2BP，上周收于 2.239%。

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	4.199	2.9	-22.7	-22.7
5 年	3.610	4.9	-39.4	-39.4
10 年	3.504	2.5	-37.1	-37.1
30 年	3.619	-3.6	-34.4	-34.4
德国国债				
2 年	2.580	0.3	-18.4	-18.4
5 年	2.258	4.8	-32.0	-32.0
10 年	2.239	6.2	-33.2	-33.2
30 年	2.195	5.4	-35.0	-35.0

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

- 美元利率掉期率震荡上行，10 年期美元利率掉期率较前周上行 4.40BP，上周收于 3.4875%。

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	4.4826	5.29	-22.57	-22.57
10 年	3.4875	4.40	-35.00	-35.00
30 年	3.2495	0.04	-24.15	-24.15

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。