

2021年2月18日

外匯基金債券投標參考資料

1. 投標中的外匯基金債券價格/收益表

投標中的外匯基金債券概覽：—

		<u>金管局發行編號: 02Y2302</u>
● 股份代號	:	4084 (EFN 0.16 2302)
● 發行日期	:	22/2/2021
● 到期日	:	22/2/2023
● 年期	:	2年
● 票面息率	:	年息 0.16%
● 發行總額	:	港幣 12 億元
● 金管局截止投標日期	:	19/2/2021 (上午 10:30)
● 公眾人仕經中央結算投標截止日期	:	17/2/2021 (下午 3:45)
● 經中央結算投標修改最後限期	:	18/2/2021 (下午 3:45)
● 經中央結算投標結果公佈日期	:	19/2/2021 (下午 6:00 後)
● 在聯交所開始買賣日期	:	23/2/2021

投標中的外匯基金債券之價格/收益率參考表：—

(資料來源：香港金融管理局 *)

- 金管局外匯基金債券編號：02Y2302

<u>到期收益率</u>	<u>價格</u>	<u>到期收益率</u>	<u>價格</u>
(0.840)	102.02	0.160	100.00
(0.790)	101.92	0.210	99.90
(0.740)	101.82	0.260	99.80
(0.690)	101.72	0.310	99.70
(0.640)	101.61	0.360	99.60
(0.590)	101.51	0.410	99.50
(0.540)	101.41	0.460	99.40
(0.490)	101.31	0.510	99.31
(0.440)	101.21	0.560	99.21
(0.390)	101.11	0.610	99.11
(0.340)	101.00	0.660	99.01
(0.290)	100.90	0.710	98.91
(0.240)	100.80	0.760	98.81
(0.190)	100.70	0.810	98.72
(0.140)	100.60	0.860	98.62
(0.090)	100.50	0.910	98.52
(0.040)	100.40	0.960	98.42
0.010	100.30	1.010	98.33
0.060	100.20	1.060	98.23
0.110	100.10	1.110	98.13
		1.160	98.04

* 免責聲明

資料僅供參考之用。金管局已力求審慎，盡可能使所載資料正確無誤，並盡快予以更新；惟金管局並不保證全部或其任何部分的資料在各方面均絕對正確。如有疑問，閣下應自行查核所載的任何資料。對於因使用或依據所載的資料而引起的任何損失或損害，金管局恕不負責。

2. 最近期發行外匯基金債券前五個交易日收市時到期收益率

與投標中的外匯基金債券具有相近到期日的最近期發行外匯基金債券(「最近期外匯基金債券」)，在前五個交易日於專業市場收市時到期收益率(作參考之用)：

投標中外匯基金債券(金管局發行編號：02Y2302)

最近期外匯基金 債券股份代號	金管局發 行編號	發行日期	到期日	票面利息 (年息%)	收市時到期收益率(年息%)*				
					09/02/21	10/02/21	11/02/21	16/02/21	17/02/21
4175	15Y2302	20/02/08	20/02/23	2.71	0.149	0.149	0.144	0.155	0.130

* 資料來源：路孚特