

2025年2月20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：—

- 金管局發行編號: 02Y2702
- 股份代號 : 4104 (EFN 3.34 2702)
 - 發行日期 : 24/2/2025
 - 到期日 : 24/2/2027
 - 年期 : 2年
 - 票面息率 : 年息 3.34%
 - 發行總額 : 港幣 12 億元
 - 金管局截止投標日期 : 21/2/2025 (上午 10:30)
 - 公眾人仕經中央結算投標截止日期 : 19/2/2025 (下午 3:45)
 - 經中央結算投標修改最後限期 : 20/2/2025 (下午 3:45)
 - 經中央結算投標結果公佈日期 : 21/2/2025 (下午 6:00 後)
 - 在聯交所開始買賣日期 : 25/2/2025

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：02Y2702

<u>到期收益率</u>	<u>價格</u>	<u>到期收益率</u>	<u>價格</u>
2.340	101.97	3.340	100.05
2.390	101.87	3.390	99.96
2.440	101.78	3.440	99.86
2.490	101.68	3.490	99.77
2.540	101.58	3.540	99.68
2.590	101.49	3.590	99.58
2.640	101.39	3.640	99.49
2.690	101.29	3.690	99.39
2.740	101.20	3.740	99.30
2.790	101.10	3.790	99.21
2.840	101.00	3.840	99.11
2.890	100.91	3.890	99.02
2.940	100.81	3.940	98.93
2.990	100.72	3.990	98.84
3.040	100.62	4.040	98.74
3.090	100.53	4.090	98.65
3.140	100.43	4.140	98.56
3.190	100.34	4.190	98.47
3.240	100.24	4.240	98.37
3.290	100.15	4.290	98.28
		4.340	98.19

* 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：02Y2702)

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%)*				
					13/02/25	14/02/25	17/02/25	18/02/25	19/02/25
4024	15Y2702	24/02/12	24/02/27	1.51	3.381	3.357	3.347	3.349	3.407

* 資料來源：路孚特