

2020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： -

		金管局發行編號: 02Y2202
● 股份代號	:	4079 (EFN 1.52 2202)
● 發行日期	:	20/2/2020
● 到期日	:	21/2/2022
● 年期	:	2年
● 票面息率	:	年息 1.52%
● 發行總額	:	港幣 12 億元
● 金管局截止投標日期	:	19/2/2020 (上午 10:30)
● 公眾人士經中央結算投標截止日期	:	17/2/2020 (下午 3:45)
● 經中央結算投標修改最後限期	:	18/2/2020 (下午 3:45)
● 經中央結算投標結果公佈日期	:	19/2/2020 (下午 6:00 後)
● 在聯交所開始買賣日期	:	21/2/2020

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：02Y2202

<u>到期收益率</u>	<u>價格</u>	<u>到期收益率</u>	<u>價格</u>
0.520	101.99	1.520	100.01
0.570	101.89	1.570	99.91
0.620	101.79	1.620	99.82
0.670	101.69	1.670	99.72
0.720	101.59	1.720	99.62
0.770	101.49	1.770	99.53
0.820	101.39	1.820	99.43
0.870	101.29	1.870	99.33
0.920	101.19	1.920	99.24
0.970	101.09	1.970	99.14
1.020	100.99	2.020	99.04
1.070	100.89	2.070	98.95
1.120	100.80	2.120	98.85
1.170	100.70	2.170	98.76
1.220	100.60	2.220	98.66
1.270	100.50	2.270	98.57
1.320	100.40	2.320	98.47
1.370	100.30	2.370	98.38
1.420	100.21	2.420	98.28
1.470	100.11	2.470	98.19
		2.520	98.09

* 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：02Y2202)

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%)*				
					11/02/20	12/02/20	13/02/20	14/02/20	17/02/20
4021	10Y2112	05/12/11	06/12/21	1.19	1.46	1.46	1.44	1.44	1.47

* 資料來源：路孚特