

出國報告（出國類別：其他）

參加 2014 年 Societe Generale 交易
研討會心得報告書

服務機關：中央銀行

姓名職稱：葉峻源(外匯局調度科/辦事員)

派赴國家：美國、紐約

出國期間：103 年 6 月 21 日至 6 月 29 日

報告日期：103 年 9 月 23 日

目 錄

壹、 前言	1
貳、 基本概念介紹	2
一、 The Canadian Model	2
二、 損益兩平通膨率	4
三、 遠期契約價格與 carry	6
四、 存續期間(duration)與 beta	7
參、 英國及歐元區通膨指數介紹與其季節性	11
一、 通膨債券主要連結物價指數介紹	11
二、 通膨指數之季節性	15
肆、 英國及歐元區主要國家通膨債券發展概況	17
一、 英國通膨連結債券發展概況	17
二、 法國通膨連結債券發展概況	19
三、 義大利通膨連結債券發展概況	21
四、 德國通膨連結債券發展概況	23
五、 西班牙通膨連結債券發展概況	25
伍、 結語	27
陸、 參考資料	30