

(四)公債的 Delta 風險資本計算

甲、T-Bond的GIRR Delta敏感性計算範例

- ◆ 評價日 2020/9/30, 30年期台幣 T-Bond[A09105], 發行日 2020/5/12, 到期日 2050/5/12, 票面利率 0.75%。

<<T_1_GIRR_TBond_Delta>>

◆使用 Svensson Model 的即期利率曲線資料，挑選 10 個利率點，來建立評價曲線。

[illegible]

◆ 使用 QuantLibXL 物件，建立債券評價計算引擎，算出初始價格，1,122,187.38。

T_1_GIRR_TBond_Delta.xlsx - Microsoft Excel										
Q19										
19										
20										
21										
22										
23										
24										
25										
26										
27										
28										
29										
30										
31										
32										
33										
34										
35										
36										
37										
38										
39										
40										
41										
42										
43										
44										

T_1_GIRR_TBond_Delta.xlsx - Microsoft Excel										
Q19										
19										
20										
21										
22										
23										
24										
25										
26										
27										
28										
29										
30										
31										
32										
33										
34										
35										
36										
37										
38										
39										
40										
41										
42										
43										
44										