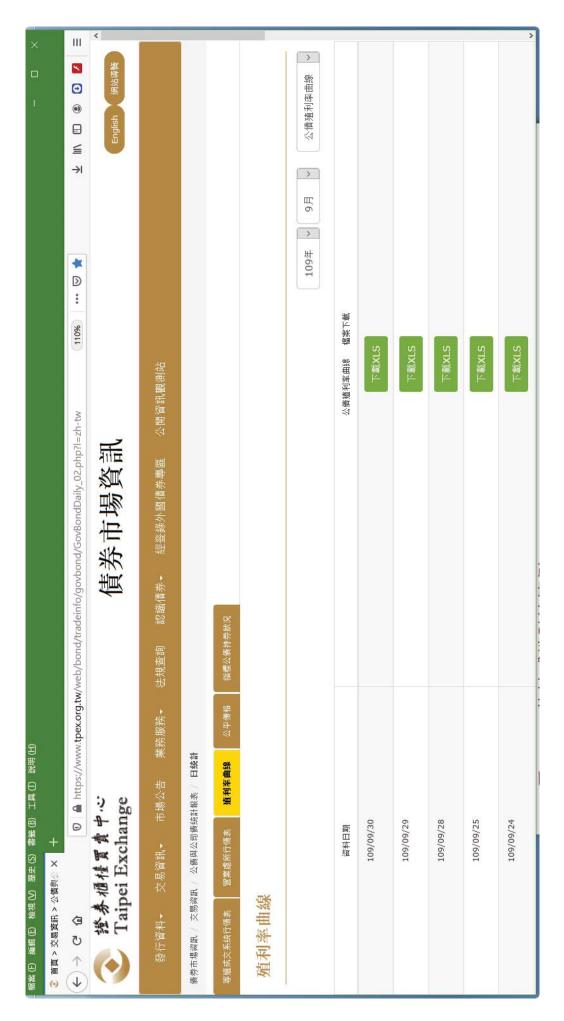
### 甲、T-Bond的GIRR Delta敏感性計算範例

◆ 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%。

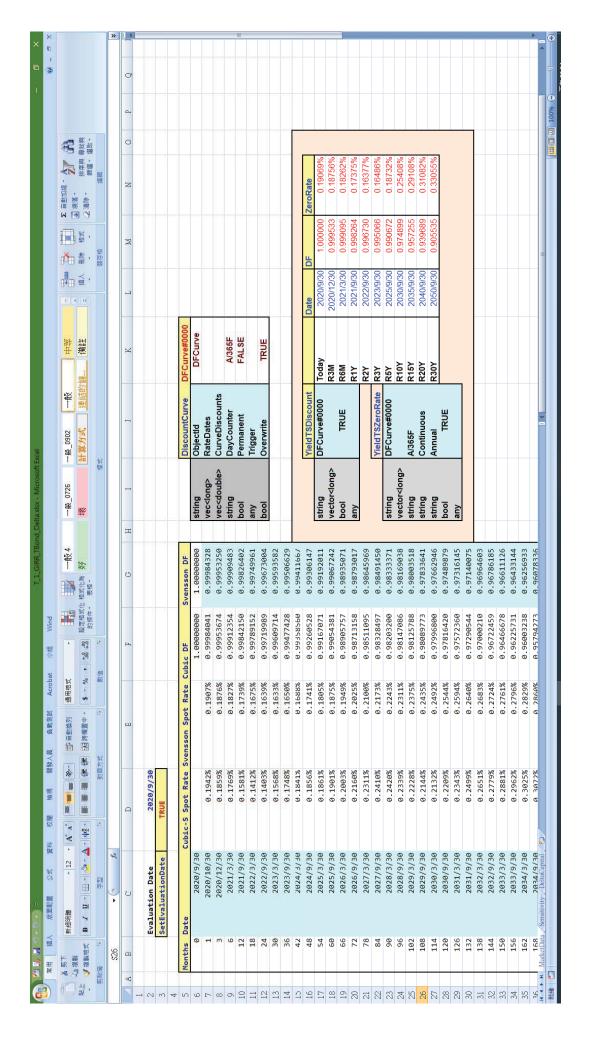
## <<T 1 GIRR TBond Delta>>

### ◆ 由櫃買中心取得 2020/9/30 公債即期利率曲線。



的騰金融科技-董夢雲 dongmy@ms5.hinet.net 24

#### 0 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



的騰金融科技-董夢雲 dongmy@ms5.hinet.net 25

# ◆ 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。

第用 语人 版画配置	置 公式 資料 校贈 檢視	開發人員 負載測試	Acrobat 小祖 Wind					
新 新 新 新 新 新 新 新 新 新 新 新 新 新 新 新 新 新 新	· 12 · K x ≡ ≡	田里	通用格式	—————————————————————————————————————	一般_0726 一般_0902	<del>神</del>		# W #
भूत सव	- ¥+ - ₹+ - ₹- ₹- ₹- ₹- ₹- ₹- ₹- ₹- ₹- ₹- ₹- ₹- ₹	+ the second sec		11	職 計算方式	連結的情 備註	植入 国家 格式 Q油家・村	排席與 尋找與 篩選、選取。
の無温極	型	要音方式	數值		松		調学器	
, 610	• (s fr							
В	0	D	н	[T.	Ð	Н	_	í
	ZeroCurve	ZeroCurve1#0000			FixedRateBond	FixedBond1#0000	Rande	RateRange#0000
0.0	o anoma			123	- Inconverse	COCCET PURCEUS I	of invi	rate rangemone
string	Objectld	ZeroCurve1		string	ObjectID	FixedBond1	String	RateRange
vec <long></long>	RateDates	C6:C16		string	Description	Issue_Test	Range	E6:E16
vec <double></double>	> Rate Yields	E6:E16		string	Currency	DWT	Permanent	FALSE
string	DayCounter	A/365F		long	SettlementDays	0	Trigger	
pool	Permanent	FALSE		double	FaceAmount	1,000,000	1,000,000 Overwrite	TRUE
any	Trigger			string	ScheduleID	Sch#0000		
pool	Overwrite	TRUE		double	Coupons	0.750%	0.750% BondEngine	BondEng1#0000
				string	DayCounter	A/365F	ObjectID	BondEng1
	3chedule	3ch#0000		string	PaymentBDC	Following	YieldCurve	ZeroCurve1#0000
string	ObjectId	Sch		elduob	Redemption	100	Permanent	FALSE
long	EffectiveDate	2020/5/12		long	IssueDate	2020/5/12 Trigger	Trigger	
long	TerminationDate	2050/5/12		string	PaymentCalendar	Null	Overwrite	TRUE
string	Tenor	17		lood	Permanent	FALSE		
string	Calendar	Null		any	Trigger		SetPricingEngine	TRUE
string	Convention	ш		pool	Overwrite	TRUE	NPV	1,122,187.38
string	TermDateConv	ш						
string	GenRule	Forward						
pool	EndOfMonth	FALSE						
long	FirstDate							
long	NextToLastDate							
bood	Permanent	FALSE						
any	Trigger							
pool	Overwrite	TRUE						
The state of the s	1 1 1 1 1 1 1 1 1 1 1 1 1 1 1 1 1 1 1 1							

的騰金融科技-董夢雲 dongmy@ms5.hinet.net 26