

for Fixing date測試

建立IRS 8/2颱風天Fixing部位

Fix Date	Accrual Start	Accrual End	Pay Date
2023/5/2	2023/5/4	2023/8/4	2023/8/4
2023/8/2	2023/8/4	2023/11/6	2023/11/6
2023/11/2	2023/11/6	2024/2/6	2024/2/6
2024/2/2	2024/2/6	2024/5/6	2024/5/6

範例設定	
交易日	2023/5/2
生效日	2023/5/4
到期日	2024/5/6

建立NDF 8/2颱風天Fixing部位

Fix Date	Payment Date
2023/8/2	2023/8/4

範例設定	
交易日	2023/8/1之前
定價日	2023/8/2
到期日	2023/8/4

建立NDF 訂價日次日遇到颱風天的部位

Fix Date	Payment Date
2023/8/1	2023/8/3

範例設定	
交易日	2023/7/31之前
定價日	2023/8/1
到期日	2023/8/3

for Payment date測試

建立IRS 8/2颱風天Payment部位

Fix Date	Accrual Start	Accrual End	Pay Date
2023/4/27	2023/5/2	2023/8/2	2023/8/2
2023/7/31	2023/8/2	2023/11/2	2023/11/2
2023/10/31	2023/11/2	2024/2/2	2024/2/2
2024/1/31	2024/2/2	2024/5/2	2024/5/2

範例設定	
交易日	2023/4/27
生效日	2023/5/2
到期日	2024/5/2

建立NDF 8/2颱風天Payment部位

Fix Date	Payment Date
2023/7/31	2023/8/2

範例設定	
交易日	2023/7/28之前
定價日	2023/7/31
到期日	2023/8/2