**HW6作業說明**

0613404 陸恭葦

一、輸入

1. 期數：輸入整數表式債券的期數

2. 每期報酬：輸入固定的每期報酬 (C)

3. yield rate：輸入每期的yield rate，為小數

4. yield spread：輸入為小數的 yield spread

5. 初始值：輸入使用牛頓法做數值估計的初始值

二、輸出

1. 在輸入完 yield spread後會先輸出用bootstrap method算出的zero rate

2. 輸入完初始值後會輸出最後數值解求出的static spread

三、使用測資

期數 2

每期報酬10

輸入yield rate1期 (以小數表示) 0.05

輸入yield rate2期 (以小數表示) 0.03

輸入yield spread 0.02

第1期zero rate: 0.05

第2期zero rate: 0.0290827

初始值 0.1

static spread 0.0208773