**ZeroCurveMaker 함수정의서**

**ZeroMakerExcel: 스왑시장이나 채권시장 데이터를 통해 ZeroCurve를 만드는 함수**

DLLEXPORT(long) ZeroMakerExcel(

long PriceDate\_Excel, // Pricing Date ExcelType

long MarketDataFlag, // 0:MMF, IRForward, Swap 사용 1:채권YTM사용

long NShortTerm, // Short Term 이자율 개수

long\* ShortTermType, // 상품타입 0:OverNight, 1: CD, Libor 등

long\* ShortTerm\_Maturity\_Excel, // Short Term 이자율 만기일 ExcelType Array

double\* ShortTerm\_Rate, // Short Term 이자율 Rate Array

long\* ShortTerm\_OneYConvention, // DayCount 1Y (360 or 365)

long NForward, // Forward 이자율 개수

long\* ForwardStart\_Excel, // Forward금리 추정시작일 ExcelType Array

long\* ForwardEnd\_Excel, // Forward금리 추정종료일 ExcelType Array

double\* ForwardRate, // Forward Rate Array

long\* Forward\_OneYConvention, // Forward Rate DayCount 1Y (360 or 365) Array

long NSwap, // 입력된 Swap 개수

long\* SwapMaturity\_Excel, // Swap 만기 ExcelType Array

long\* NCPN\_Ann, // Swap 연 이자지급 회수 Array

double\* SwapRate, // Swap Rate Array

long\* Swap\_OneYConvention, // Swap DayCount 1Y (360 or 365)

long NResultCurve, // Out: 결과 커브 Term 개수

double\* ResultCurveTerm, // Out: 결과 커브 Term Array

double\* ResultCurve, // Out: 결과 커브 Rate Array

char\* Error // Out: 에러메시지

)

기타함수:

double CalcZeroRateFromSwapRate: Swap Rate로부터 특정 만기의 ZeroRate계산

double CalcZeroRateFromCouponBond: 쿠폰채로부터 특정 만기의 ZeroRate계산

DLLEXPORT(double) Calc\_IRS(

long PricingDate\_Excel, // Pricing Date ExcelType

long SwapMaturityDate\_Excel, // 스왑만기 ExcelType

long Number\_Ann\_CPN, // 스왑 연 이자지급수

long Convention1Y, // DayCount 1Y (360 or 365)

long NRate, // CurveTerm개수

double\* RateTerm, // CurveTerm Array

double\* Rate // CurveRate Array

)

: Swap Rate 계산

**ZeroCurveMaker 로직설명**

1. **Swap Rate의 경우**
2. **Bond의 경우**