

## #Homework 8



- 請分析如何使用拔靴法（bootstrap method）和市場新台幣利率交換（Interest Rate Swap，IRS）報價資料來計算零息債券的利率（zero coupon rate），並撰寫計算零息利率的程式。
- 假定一年交換一次,第4,6年資料用內插估計

到期日 (年)	Bid (%)	Offer (%)	Swap rate (%)
1	2.25	2.27	2.26
2	2.26	2.29	2.275
3	2.27	2.30	2.285
5	2.33	2.38	2.355
7	2.41	2.47	2.44

資料來源(此為參考資料)

2008年9月15日

Swap rate為買賣價之平均值

KGI凱基證券網站

[http://www.kgiworld.com.tw/bond/bond\\_01\\_02.htm](http://www.kgiworld.com.tw/bond/bond_01_02.htm)

請繳交 PDF 檔

檔名：HW8\_學號\_姓名