

固定收益证券

期末报告

布置时间：2023 年 5 月 23 日

上交时间：2023 年 7 月 3 日

不超过 4 人一组，自选语言，完成如下工作，请在报告中列明每个人的工作贡献：收集中国国债市场和美国国债市场连续三天的债券交易数据，编写程序，运用线性插值、Hermit 三次多项式插值、三次样条插值、贴现因子函数的三次多项式样条、NS 模型和 NSS 模型拟合利率期限结构，并比较上述方法的优劣。