

## 基于三次样条的利率期限结构估计中的节点选择

李熠熠, 潘婉彬, 缪柏其

收稿日期 修回日期 网络版发布日期 接受日期

**摘要** 将节点逐点删除方法应用于上海证券交易所交易的国债的利率期限结构拟合中样条函数的节点选择上, 并对利率期限结构进行了拟合. 对基于节点逐点删除方法所得到的节点选择与较常用的5年和8年、7年和14年这两种节点选择进行了比较, 样本外预测结果显示, 基于节点逐点删除方法所得到的模型对短中长期国债的预测效果都比已有模型好, 提高了期限结构定价的准确性.

**关键词** [期限结构](#) [三次样条函数](#) [节点选择](#)

分类号

**DOI:**

对应的英文版文章: [2009040028](#)

通讯作者:

作者个人主页: 李熠熠; 潘婉彬; 缪柏其

### 扩展功能

本文信息

▶ [Supporting info](#)

▶ [PDF](#) (587KB)

▶ [\[HTML全文\]](#) (0KB)

▶ [参考文献\[PDF\]](#)

▶ [参考文献](#)

服务与反馈

▶ [把本文推荐给朋友](#)

▶ [加入我的书架](#)

▶ [加入引用管理器](#)

▶ [引用本文](#)

▶ [Email Alert](#)

相关信息

▶ [本刊中 包含“期限结构”的 相关文章](#)

▶ 本文作者相关文章

· [李熠熠](#)

· [潘婉彬](#)

· [缪柏其](#)