

Projekt nr. 2:

Konvertering af kreditforeningslån.

Datamaterialet til denne opgave er formidlet af Mette Rysø Johansen, Nykredit. Data er stillet til rådighed til undervisningsformål, hvilket normalt betyder at de ikke må bruges til andet (for eksempel videregives til uvedkommende eller bruges som grundlag for forskning der offentliggøres) uden ejerens (Nykredits) tilladelse.

Data vedrører konvertering af lån baseret på visse obligationsserier over en periode på seks kvartaler (2. kvartal 2001 til 3. kvartal 2002). Data foreligger i form af seks Excel regneark,

funding2001_2_1.xls

...

funding2002_3_1.xls

som vil blive udsendt. Hver af disse filer indeholder data for et kvartal. Hver linie svarer til en obligationsserie, og søjlerne indeholder i naturlig rækkefølge følgende oplysninger.

1. Fondskode
2. Udløbsår
3. Rentefod (kuponrenten)
4. Valuta (DKK eller EUR)
5. Samlet obligationsmængde (i DKK)
6. Antal indfrielse
7. Summen af indfrielse

Formålet med opgaven er at opstille en model, der beskriver konverteringshyppigheden som funktion af andre variable. Her kan være tale om variable som indgår i data, såsom rentefod eller udløbsår. Men også forskellige nationaløkonomiske indikatorer, som vi må skaffe andre steder fra, kan være relevante som forklarende variable i modellen. Det vil i særdeleshed være relevant at inddrage variable, der kan fortælle noget om de mulige alternativer til eksisterende lån.

Projektet afleveres fredag d. 20. december.