



FAI3008 Det finansiella systemet i teori och praktik 7,5 hp

The Financial System in Theory and Practice

När kurs inte längre ges har student möjlighet att examineras under ytterligare två läsår.

Fastställande

Kursplan för FAI3008 gäller från och med HT19

Betygsskala

P, F

Utbildningsnivå

Forskarnivå

Särskild behörighet

Grundläggande kurser i matematik, statistik och ekonomi.

Undervisningspråk

Undervisningspråk anges i kurstillfällesinformationen i kurs- och programkatalogen.

Lärandemål

Kursens mål är att ge deltagarna en introduktion till teorin kring prissättning av finansiella tillgångar och hur dessa modeller ger ett samband mellan finansiell ekonomi och makroekonomi. Fokuset ligger på teoretiska modeller, men några empiriska problemställningar kommer också att tas upp.

Kursinnehåll

- Preferenser, nyttofunktioner, risk och osäkerhet.
- Konsumtionsbaserad prissättning av finansiella tillgångar.
- Stokastiska diskonteringsfaktorer, lagen om ett pris och arbitrage.
- Väntevärde-varians-analys och CAPM.
- Faktormodeller och APT.
- Prissättning av finansiella tillgångar och makroekonomiska modeller.
- Empiriska frågeställningar.

Kurslitteratur

Kompendium

Examination

- INL1 - Inlämningsuppgift, 7,5 hp, betygsskala: P, F
- UPP1 - Uppsats, 7,5 hp, betygsskala: P, F

Examinator beslutar, baserat på rekommendation från KTH:s handläggare av stöd till studenter med funktionsnedsättning, om eventuell anpassad examination för studenter med dokumenterad, varaktig funktionsnedsättning.

Examinator får medge annan examinationsform vid omexamination av enstaka studenter.

Övriga krav för slutbetyg

Inlämningsuppgifter samt aktivitet deltagande under föreläsningarna.

Etiskt förhållningssätt

- Vid grupparbete har alla i gruppen ansvar för gruppens arbete.
- Vid examination ska varje student ärligt redovisa hjälp som erhållits och källor som använts.
- Vid muntlig examination ska varje student kunna redogöra för hela uppgiften och hela lösningen.