



SF2942 Portföljteori och riskvärdering 7,5 hp

Portfolio Theory and Risk Management

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

Fastställande

Kursplan för SF2942 gäller från och med HT12

Betygsskala

A, B, C, D, E, FX, F

Utbildningsnivå

Avancerad nivå

Huvudområden

Industriell ekonomi, Matematik

Särskild behörighet

Avklarade kurser i en- och flervariabelanalys, linjär algebra, differentialekvationer, matematisk statistik, numerisk analys

Avklarad kurs i optimeringslära rekommenderas

Undervisningsspråk

Undervisningsspråk anges i kurstillfällesinformationen i kurs- och programkatalogen.

Lärandemål

Efter fullgjord kurs förväntas studenten kunna använda och kombinera metoder och teori för ränteinstrument, finansiella derivat, portföljanslys och riskvärdering för att lösa sammansatta problem.

Kursinnehåll

Ränteteori, obligationer, terminsstrukturer, immunisering, finansiella derivat, kvadratiska kriterier för optimal hedging och investering, portföljanslys med nyttoteori, teori för riskmått och användning av riskmått i portföljvalproblem.

Kurslitteratur

Hult, Lindskog, Hammarlid and Rehn: Risk and Portfolio Analysis: Principles and Methods, Springer

Examination

- TEN₁ - Tentamen, 7,5 hp, betygsskala: A, B, C, D, E, FX, 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

En skriftlig tentamen (7,5 hp). Frivilliga hemtal.

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.