



SF2942 Portföljteori och riskvärdering 7,5 hp

Portfolio Theory and Risk Management

Fastställande

Skolchef vid SCI-skolan har 2020-04-15 beslutat att fastställa denna kursplan att gälla från och med HT 2020, diarienummer: S-2020-0374.

Betygsskala

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

Utbildningsnivå

Avancerad nivå

Huvudområden

Industriell ekonomi, Matematik

Särskild behörighet

- Slutförd kurs i flervariabelanalys (SF1626, SF1674 eller motsvarande)
- Slutförd kurs i linjär algebra (SF1624, SF1672 eller motsvarande)
- Slutförd kurs i matematisk statistik (SFSF1918, SF1922 eller motsvarande).

Undervisningsspråk

Undervisningsspråk anges i kurstillfällesinformationen i kurs- och programkatalogen.

Lärandemål

Studenten ska kunna formulera samt tillämpade teoretiska koncepten och de matematiska metoderna inom portföljoptimering och riskteori.

Kursinnehåll

Grundläggande arbitrage teori för deterministiska betalningsflöden och finansiella derivat, kvadratiske kriterier för optimal hedging och investering, portföljanalys med nyttoteori, teori för riskmått och användning av riskmått i portföljvalsproblem.

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 enskilda studenter.

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

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.