



SF2974 Portföljteori och riskvärdering 6,0 hp

Portfolio Theory and Risk Management

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

Fastställande

Kursplan för SF2974 gäller från och med HT09

Betygsskala

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

Utbildningsnivå

Avancerad nivå

Huvudområden

Industriell ekonomi, Matematik

Särskild behörighet

Kunskaper i optimeringslära motsvarande SF1811/5B1712 och kunskaper i matematisk statistik SF1901 (5B1501) eller motsvarande.

Undervisningsspråk

Undervisningsspråk anges i kurstillfällesinformationen i kurs- och programkatalogen.

Lärandemål

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

Kursinnehåll

Ränteteori, obligationer, terminsstrukturer, immunisering, effektiva portföljer, Markowitz portföljanslys, en- och tvåfondssatserna, CAPM, faktormodeller, portföljanslys med nytte-teori, teori för riskmått och användning inom portföljvalsproblem.

Kurslitteratur

Material från institutionen.

Examination

- TEN₁ - Tentamen, 6,0 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 (6 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.