



AI1177 Finansiell ekonometri

7,5 hp

Financial Econometrics

Fastställande

Kursplan AI1177 gäller f o m VT20

Betygsskala

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

Utbildningsnivå

Grundnivå

Huvudområden

Teknik

Särskild behörighet

AI1178 Tillämpad matematik och statistik för ekonomer.

Undervisningsspråk

Undervisningsspråk anges i kurstillfällesinformationen i kurs- och programkatalogen.

Lärandemål

Efter godkänd kurs ska studenten kunna:

- Analysera priser och avkastningar för viktiga ekonomiska tidsserier med fokus på fastighets- och finansmarknader
- Estimera linjära univariata och multivariata ekonometrisk modeller för ekonomiska tidsserier med hjälp av datorstöd
- Utföra prediktioner och hypotesprövningar med hjälp av datorstöd
- Tolka och analysera resultat som baseras på tidsserieekonometrisk metoder

Kursinnehåll

- Finansiella tidsserier och datakällor
- Klassisk linjär regressionsanalys
- Deskriptiv statistik av fastighets- och finansdata
- Ekonometrisk analys av univariata tidsserier
- Ekonometrisk analys av multivariata tidsserier
- Tidsvarierande parametrar, volatilitet och korrelationer

Examination

- INL1 - Inlämningsuppgift, 3,5 hp, betygsskala: P, F
- TEN1 - Tentamen, 4,0 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.

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

Plussare: Redan godkända (A-E) tentamina kan inte skrivas igen.

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.