



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

Skolchef vid SCI-skolan har 2022-02-24 beslutat att fastställa denna kursplan att gälla från och med VT 2022, diarienummer: S-2022-0529

Betygsskala

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

Utbildningsnivå

Avancerad nivå

Huvudområden

Industriell ekonomi, Matematik

Särskild behörighet

- Engelska B / Engelska 6
- 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).

Undervisningspråk

Undervisningspråk 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, kvadratiska kriterier för optimal hedging och investering, portfölj-analys 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 enstaka studenter.

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.