



Kursplan

Ekonomihögskolan

Institutionen för nationalekonomi och statistik

4NA015 Avancerade teman i analytisk finans, 7,5 högskolepoäng

Advanced Topics in Analytical Finance, 7.5 credits

Huvudområde

Nationalekonomi

Ämnesgrupp

Nationalekonomi

Nivå

Avancerad nivå

Fördjupning

A1N

Fastställande

Fastställd 2024-02-05.

Kursplanen gäller från och med hösttermin 2024.

Förkunskaper

Grundläggande behörighet för avancerade studier och minst 30 hp i nationalekonomi, statistik, finans, matematik, eller motsvarande. Engelska 6, eller motsvarande.

alternativt,

Studenter som söker till kursen inom Civilekonomprogrammet behöver ha minst 90 hp företagsekonomi eller nationalekonomi inkluderat:

15 hp finansiell ekonomi eller nationalekonomi,

statistik 15 hp

Engelska 6, eller motsvarande.

Mål

Efter avslutad kurs förväntas studenten kunna:

- tolka och utvärdera avancerade teman inom analytisk finans
- tillämpa lämpliga kvantitativa metoder vid analys av finansrelaterade problem
- redovisa och kritiskt granska teman inom analytisk finans i skriftligt/muntligt format

Innehåll

Kursen innehåller:

- empirisk prissättning av tillgångar och tvärsnitt på avkastning
- avancerad portföljoptimering
- hållbara finanser
- beroendestruktur och copulas
- maskininlärning inom finanssektorn

Undervisningsformer

Undervisningen består av föreläsningar, datorlaborationer och seminarier.

Examination

Kursen bedöms med betygen A, B, C, D, E eller F.

Kursen bedöms med betygen A, B, C, D, E, Fx eller F.

Kursen examineras genom en individuell skriftlig uppgift 4,5 hp och skriftliga gruppuppgifter med tillhörande presentationer 3 hp.

Betyget A utgör det högsta betygssteget, resterande betyg följer i fallande ordning där betyget E utgör det lägsta betygssteget för att vara godkänd. Betyget F innebär att studentens prestationer bedömts som underkända.

Omexamination ges i enlighet med Lokala regler för kurs och examination på grundnivå och avancerad nivå vid Linnéuniversitetet.

I det fall student med funktionsnedsättning har rätt till särskilt pedagogiskt stöd beslutar examinator om anpassad eller alternativ examination.

Kursvärdering

Kursvärdering genomförs under kursen eller i nära anslutning till kursens avslutning. Resultat och analys av genomförd kursvärdering ska skyndsamt återkopplas till de studenter som genomfört kursen. Studenter som deltar vid nästa kurstillfälle ska senast vid kursstart informeras om föregående kursvärderingsresultat och genomförda förändringar i kursen.

Övrigt

I de fall undervisningsspråket i kursen är engelska kommer även examinationer ges på engelska.

Kurslitteratur och övriga läromedel

Obligatorisk litteratur

Vetenskapliga artiklar. Cirka 500 sidor.