

Kursplan för läsåret 2001/2002

FINANS II B

TEK110

Economics, Finance II B

Poäng: 5.0 **Betygskala:** TH. **Valfri för:** I4IE. **Kursansvarig:** Univ lektor Hossein Asgharian. **Förkunskapskrav:** För tillträde till kursen krävs NEK203 eller motsvarande varav Mikroekonomisk analys B (NEK341) och Mikroekonomisk analys C (NEK343), 5 + 5 poäng samt Quantitative Methods (NEK333), 5 poäng eller motsvarande.. **Prestationsbedömning:** Undervisningen består av föreläsningar och lektioner. Examinationen är skriftlig och äger rum vid slutet av delkursen. Ytterligare provtillfälle anordnas i nära anslutning härtil. Obligatoriska övningsuppgifter kan förekomma inom kursen. **Webbsida:** <http://www.nek.lu.se> **Övrigt:** För ytterligare information kontakta Nationalekonomiska institutionen.

Mål:

Målet med kursen är att ge fördjupande kunskaper i ekonomisk teori samt ge förmåga att självständigt och kritiskt handskas med empiriskt material och tillämpa en vetenskaplig analysmetod.

Innehåll:

Kursen syftar till att fördjupa studenternas förståelse av ekonometriska metoder som används för att testa teoretiska modeller för prissättning av finansiella tillgångar. Kursen inleds med en genomgång av ekonometriska estimeringsmetoder som OLS, Maximum Likelihood och GMM. Därefter behandlas teoretiska grundmodeller inom finansiell ekonomi och hur ekonometriska metoder kan användas för att testa de teoretiska hypoteserna. Tyngdpunkten ligger på "Mean Variance Portfolio Efficiency", "Capital Asset Pricing Model" och "Multifactor Asset Pricing Model". Kursen innehåller en mängd dataövningar som syftar till att ge god färdighetsträning i att analysera ekonometriska problem.

Kursen förutsätter kunskaper motsvarande Finansiell ekonomi II A. Kursen ges på engelska.

Litteratur:

Selected chapters from Campbell et al., 1997, The Econometrics of Financial Markets. Lecture notes and selected articles.
Cuthbertson, 1996, Quantitative Financial Economics: Stocks, Bonds and Foreign Exchange, Dowd, 1998, Beyond Value at Risk, Greene, 1997, Econometric Analysis, Huang och Litzenberger, 1988, Foundations for Financial Economics.