

Kursplan för kalenderåret 2005

EMPIRISK FINANSIELL EKONOMI TEK110 Economics, Finance

Antal poäng: 5. **Betygskala:** TH. **Valfri för:** I4. **Kursansvarig:** Univ.lektor Hossein Asgharian, Nationalekonomiska inst.

Förkunskapskrav: TEK120 Mikroekonomisk teori B, TEK130 Mikroekonomisk teori C, grundläggande finansiell ekonomi och statistik. **Prestationsbedömning:** Undervisningen består av föreläsningar och lektioner. Examinationen är skriftlig och äger rum vid slutet av delkursen. Ytterligare provtillfälle anordnas i nära anslutning här till. Obligatoriska övningsuppgifter kan förekomma inom kursen. **Övrigt:** Kursen ges på engelska. För ytterligare information kontakta Nationalekonomiska institutionen. **Hemsida:** <http://www.nek.lu.se>.

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.

Litteratur

Campbell, J.Y., Lo, A.W. & Macinlay, A.C.: The Econometrics of Financial Markets. Princeton University Press 1998.
Brooks, C.: Introductory Econometrics for Finance. Cambridge University Press 2002.