

Avancerade forskningsmetoder i finans, 7,5 hp
Advanced Research Methods in Finance, 7,5 HE credits

Beslutad: 2022-06-02

Beslutande:

Gäller från: H22

Kursens mål

Syftet med denna kurs är att presentera ekonometriska tekniker som används i empirisk finansiell forskning och att göra studenterna medvetna om hur dessa tekniker kan tillämpas.

Efter avslutad kurs ska studenten kunna:

Kunskap och förståelse

- beskriva de centrala modellerna som används på avancerad nivå i modern finansiell ekonometri

Färdighet och förmåga

- tillämpa ekonometriska metoder och tolkning av resultaten på en avancerad nivå

Värderingsförmåga och förhållningssätt

- värdera de mest lämpliga finansiella modeller och ekonometriska metoderna för att lösa komplexa problem.

Behörighetskrav

Kandidatexamen om 180 hp med 90 hp i huvudområdet nationalekonomi med minst 7,5 hp i finans på nivå 31-60 samt 7,5 hp i ekonometri eller statistik, eller motsvarande.

Alternativt en kandidatexamen om 180 hp med 90 hp i huvudområdet företagsekonomi, minst 7,5 hp i mikroekonomi och 7,5 hp i makroekonomi och minst 7,5 hp i finans på nivå 31-60 samt 7,5 hp i ekonometri eller statistik, eller motsvarande. Engelska 6 eller motsvarande.

Formerna för bedömning av studenternas prestationer

Skriftlig individuell salstentamen. Närmare anvisningar, betygskriterier, och tidplan för samtliga bedömningsmoment för ordinarie examination samt omprövning delges studenterna skriftligt i kurs-PM vid kursens start.

Kursens innehåll

Syftet med denna kurs är att presentera de ekonometriska tekniker som används i empirisk

finansforskning och hur dessa tekniker kan tillämpas med hjälp av en ekonometrisk programvara.

Huvudämnena i kursen är:

- Den klassiska linjära regressionsmodellen (enkel och multipel)
- Univariat tidsseriemodellering
- Multivariata modeller
- Modellering av långsiktiga relationer inom finans
- Modellering av volatilitet
- Paneldata

Övriga föreskrifter

Betygskala: F/Fx/E/D/C/B/A - Otillräckligt, Otillräckligt - ytterligare prestationer krävs innan betyg kan ges, Tillräckligt, Tillfredsställande, Bra, Mycket bra, Utmärkt

Undervisningsspråk: Undervisningen bedrivs på engelska.

Generella regler för examination vid Högskolan Väst finns på www.hv.se.

Om den studerande har ett beslut/rekommendation om särskilt pedagogiskt stöd på grund av funktionsnedsättning har examinator rätt att examinera den studerande i en anpassad examinationsform.

Nivå

Avancerad nivå

Successiv fördjupning

A1F - avancerad nivå, har kurs/er på avancerad nivå som förkunskapskrav

Huvudområde(n)

Nationalekonomi