



Statistiska institutionen
Johan Koskinen
05-03-25

VT 2005

Anvisningar till FINANSIELL STATISTIK, grundkurs, 10 poäng, vt 2005

Litteratur

Lee, C.F., Lee, J.C. and Lee, A.C. (2000). *Statistics for Business and Financial Economics*. World Scientific, Singapore. Andra upplagan.

Thorburn, Daniel och Larsson, Rolf (2005). *Kompendium till kursen i finansiell statistik* (10 poäng), vt-05.

Undervisning

Undervisningen består av föreläsningar (F), övningar (Ö), samt dataövningar (D) enligt schema. Schema för Finansiell statistik, gk, vt-05, finns på institutionens hemsida www.statistics.su.se/grundutbildning/finstat.shtml, samt anslaget på institutionens anslagstavlor (hus B, plan 3 samt plan 7).

Föreläsningar

Med reservation för ändringar kommer föreläsningarna behandla följande

- F1 Allmän information; deskriptiv statistik: Lee, kap 1-4
- F2 Forts. deskriptiv statistik samt Sannolikhete Steori: Lee, kap 5 inkl. 5A
- F3 Forts. sannolikhete Steori
- F4 Diskreta variabler: Lee, kap 6 inkl. 6A och 6B
- F5 Forts. diskreta variabler: Lee, kap 6 inkl. 6A och 6B
- F6 Kontinuerliga variabler: Lee, kap 7.1-3,5; 7A, 7B
- F7 Forts. kontinuerliga variabler: Lee, kap 9.1-8; 9A, 9B
- F8 Sampling, samplingfördelningar och CGS: Lee, kap 8; Punktskattning: Lee, kap 10.1-2
- F9 Intervallskattningar: Lee, kap 10.3-7
- F10 Hypotesprövning: Lee, kap 11
- F11 Forts. hypotesprövning.
- F12 Variansanalys och χ^2 -test: Lee, kap 12.
- F13 Regression: Lee, kap 13.
- F14 Forts. regression: Lee, kap 14.
- F15 Forts. regression: Lee, kap 15.
- F16 Forts. regression: Lee, kap 16.
- F17 Logistisk regression: Kompendium, del I, kap 2.
- F18 Icke-parameteriska test: Lee, kap 17; Index: Lee, kap 19 samt Kompendium, del I, kap 1.
- F19 Tidsserieanalys: Lee, kap 18.1-5.
- F20 Forts. tidsserieanalys: Lee, kap 18.6, samt Kompendium, del I, kap 3.1-5; del II, kap 2.1.
- F21 Forts. tidsserieanalys: Kompendium, del I, kap 3.7 och kap 4; del II, kap 2.3-4.
- F22 Forts. tidsserieanalys.
- F23 Forts. tidsserieanalys: Kompendium, del II, kap 3 och kap 4.
- F24 Beslutsteori: Lee, kap 21.
- F25 Genomgång av övningsskrivning och reserv.

Åhörarkopior och relevant undervisningsmaterial skall i möjligaste mån finnas tillgängliga som nedladdningsbara filer på www.statistics.su.se/grundutbildning/finstat.shtml i nära anslutning till föreläsningarna.

Övningar

På övningarna ges handledning i lösning av statistiska problem samt ledning och administration av inlämningsuppgiften. Vid de olika seminarietillfällena kommer ett urval av följande behandlas

- Ö1 Utdelning av inlämningsuppgiften med introduktion;
kap 4: 1, 4, 9, 32, 53, 54;
kap 5: 2, 5, 10, 18, 20, 36, 44, 52, 66, 69;
- Ö2 kap 6: 3, 4, 6, 9, 11, 20, 34, 36, 57, 70
kap 7: 3, 9, 17, 18, 21, 27, 32, 33, 43, 52, 60, 64.
- Ö3 kap 9: 12, 40
kap 10: 4, 6, 8, 22, 30, 37, 68, 73, 74.
- Ö4 kap 8: 1, 9, 11, 18, 26, 28, 54
kap 11: 1, 6, 10, 22, 23, 38, 55, 62, 66, 96.
- Ö5 kap 13: 1, 2, 6, 10, 16, 33, 34, 35
kap 14: 1, 11, 14, 23, 31, 32, 49, 60, 63.
- Ö6 kap 15: 2, 4, 9, 10, 19, 22, 23, 24, 27, 28, 29, 30, 54, 57
kap 19: 23, 24, 25, 34, 42, 45
Kompendiet, del I, kap 2, övn. 1.
- Ö7 kap 18: 3, 8, 15, 16, 32, 43, 44, 45, 51, 53, 54, 55, 56, 57
kap 21: 2, 3, 4, 5, 6, 8, 13, 35, 38, 46, 61, 62, 63.
- Ö8 reservövning

Datorövningar

Vid de schemalagda övningarna ges främst handledning för inlämningsuppgiften. Dessutom ges det möjlighet att bekanta sig med flera olika statistiska programpaket samt att lösa uppgifter i Lee som kräver exempelvis Minitab eller Exel.

Examination

Kursen examineras dels genom en **obligatorisk inlämningsuppgift omfattande 2 poäng** och dels genom en skriftlig **tentamen omfattande 2 ggr 4 poäng**, dvs. totalt **8 poäng**.

Inlämningsuppgift

Inlämningsuppgiften består av *tre delar* som skall lösas och redovisas skriftligt. Uppgiften är inte individuell utan kan lösas i grupper om 2 till 3 personer. Detaljerade anvisningar kommer att ges i samband med undervisning enligt informationen som ges vid föreläsningstillfälle 1, F1. *Samtliga tre delar* skall vara att betrakta som avklarade för att inlämningsuppgiften skall bli godkänd. Eventuellt avklarade delar kan ej tillgodoräknas efter kursens slut såtillvida inte inlämningsuppgiften i sin helhet är godkänd.

Tentamen

Den skriftliga tentamen är individuell. Tillåtna hjälpmedel vid skrivningstillfället är: miniräknare samt vid tentamenstillfället utdelad formel- samt tabellsamling. Tentamen är uppdelad i två delar om vardera 4 poäng, *Sannolikhetslära och inferens* samt *Finansiella metoder*.

OBS: Tentamensanmälan måste göras senast en vecka före tentamensdatum. Anmälan görs via www.mitt.su.se, eller på anmälningslista i pärmen utanför studentexpeditionen i hus B, plan 7.

Betygssättning

För inlämningsuppgiften 2 poäng ges något av betygen godkänd eller underkänd. För del 1, *Sannolikhetslära och inferens*, av den skriftliga tentamen, ges något av betygen väl godkänd, godkänd eller underkänd. För del 2, *Finansiella metoder*, av den skriftliga tentamen, ges något av betygen väl godkänd, godkänd eller underkänd.

För godkänt på kursen Finansiell statistik 10 poäng krävs betyget godkänt på inlämningsuppgiften 2 poäng samt minst betyget godkänt för de i den skriftliga tentamen ingående delarna. För betyget väl godkänt på kursen Finansiell statistik 10 poäng krävs godkänd inlämningsuppgift samt betyget väl godkänt på *båda* 4-poängsdelarna i den skriftliga tentamen.

Lärare

Johan Koskinen, rum B788, 16 29 90, johan.koskinen@stat.su.se
Bertil Wegmann, rum B784, 16 29 74, bertil.wegmann@stat.su.se

Jourhavande lärare:

Anita Normark, rum B782, tel 162992.