



Kursplan

för kurs på grundnivå

Tidsserieanalys, diplomeringskurs för aktuari

Time Series Analysis, Certification Course for Actuaries

1.5 Höskolepoäng

1.5 ECTS credits

Kurskod: MT4006
Gäller från: HT 2019
Fastställt: 2013-10-08
Ändrad: 2013-10-08
Institution: Matematiska institutionen

Huvudområde: Matematisk statistik
Fördjupning: G1F - Grundnivå, har mindre än 60 hp kurs/er på grundnivå som förkunskapskrav

Beslut

Denna kursplan är fastställd av Naturvetenskapliga fakultetsnämnden vid Stockholms universitet 2013-10-08.

Teknisk revidering av Studentavdelningen 2019-04-26.

Förkunskapskrav och andra villkor för tillträde till kursen

Kunskaper motsvarande Statistisk analys, 7,5 hp (MT4001).

Kursens uppläggning

Provkod	Benämning	Höskolepoäng
HELA	Tidsserieanalys, diplomeringskurs för aktuari	1.5

Kursens innehåll

Kursen behandlar grundläggande teknik för modellering av tidsberoende data. ARMA-modeller, prediktion och parameterskattning.

Förväntade studieresultat

Efter att ha genomgått kursen förväntas studenten kunna:

- * redogöra för grundläggande modeller för tidsseriedata
- * i enkla fall tillämpa metoder för prediktion och parameterskattning

Undervisning

Undervisning består av föreläsningar och räkneövningar.

Kunskapskontroll och examination

a. Kursen examineras på följande vis: kunskapskontroll sker genom skriftligt redovisning av inlämningsuppgift.

b. Betygssättning sker enligt sjugradig målrelaterad betygsskala:

- A = Utmärkt
- B = Mycket bra
- C = Bra
- D = Tillfredsställande
- E = Tillräckligt

Fx = Otillräckligt
F = Helt otillräckligt

c. Kursens betygskriterier delas ut vid kursstart.

d. För godkänt krävs lägst betygsgraden E.

e. Studerande som underkänts i ordinarie prov har rätt att genomgå ytterligare prov så länge kursen ges. Antalet provtillfällen är inte begränsat. Med prov jämföras också andra obligatoriska kursdelar. Studerande som godkänts på prov får inte genomgå förnyat prov för högre betyg. Studerande som underkänts på prov två gånger har rätt att begära att annan examinator utses vid nästkommande prov. Framställan härom ska göras till institutionsstyrelsen. Kursen har minst två examinationstillfällen per läsår de år då undervisning ges. Mellanliggande år ges minst ett examinationstillfälle.

f. Möjlighet till komplettering av betyget Fx upp till godkänt betyg ges inte på denna kurs.

Övergångsbestämmelser

Studerande kan begära att examination genomförs enligt denna kursplan även efter det att den upphört att gälla, dock högst tre gånger under en tvåårsperiod efter det att undervisning på kursen upphört. Framställan härom ska göras till institutionsstyrelsen. Bestämmelsen gäller även vid revidering av kursplanen.

Begränsningar

Kursen kan ej ingå i examen tillsammans med Ekonometri (MT4004) eller motsvarande.

Övrigt

Kursen uppfyller Svenska Aktuarieföreningens krav på kunskaper i tidsserieanalys för en diplomerad aktuarie.

Kurslitteratur

Kurslitteratur beslutas av institutionsstyrelsen och redovisas därefter i bilaga till kursplanen.