



## Kursplan

Ekonomihögskolan

Institutionen för nationalekonomi och statistik

1NA074 Portfolio Choice Theory, 7,5 högskolepoäng

Portfolio Choice Theory, 7.5 credits

### Huvudområde

Nationalekonomi

### Ämnesgrupp

Nationalekonomi

### Nivå

Grundnivå

### Fördjupning

G1F

### Fastställande

Fastställd 2014-11-12.

Reviderad 2024-02-05. Revidering av poängsatta examinerande moment, mål, innehåll, examinationstext och uppdatering av standardtexter.

Kursplanen gäller från och med hösttermin 2024.

### Förkunskaper

Nationalekonomi 30 hp, inklusive kurspoäng i grundläggande mikro- och makroekonomi och Statistik 15 hp, eller motsvarande. Engelska 6, eller motsvarande.

### Mål

Efter avslutad kurs förväntas studenten kunna:

- analysera förhållanden och skeenden på finansiella marknader
- redogöra för olika finansiella tillgångar, vilka risker investeringar i finansiella tillgångar medför och hur finansiella tillgångar kan användas för att skydda sig mot risker

- förklara prisbildning på de finansiella marknaderna och fundamentala teorier inom finansiell ekonomi
- redogöra för ränteteori och portföljvalsteori
- beräkna finansiella samband och pris på finansiella tillgångar

## Innehåll

Kursen innehåller:

- finansiella marknader och finansiella tillgångar
- risk, avkastning, den effektiva fronten för placeringar i risktillgångar och optimal portföljsammansättning
- CAPM, APT och utvärdering av riskfyllda placeringar
- ränteberäkningar och avkastningsanalyser
- lagen om ett pris, arbitrage och effektiva marknadshypotesen på de finansiella marknaderna
- riskhantering/risk management med finansiella tillgångar
- behavioristisk finansiell ekonomi

## Undervisningsformer

Undervisningen består av föreläsningar och gruppövningar.

## Examination

Kursen bedöms med betygen A, B, C, D, E eller F.

Kursen examineras genom en individuell skriftlig tentamen 4,5 hp och skriftlig gruppuppgift 3 hp.

Betyget A utgör det högsta betygssteget, resterande betyg följer i fallande ordning där betyget E utgör det lägsta betygssteget för att vara godkänd. Betyget F innebär att studentens prestationer bedömts som underkända.

Omexamination ges i enlighet med Lokala regler för kurs och examination på grundnivå och avancerad nivå vid Linnéuniversitetet.

I det fall student med funktionsnedsättning har rätt till särskilt pedagogiskt stöd beslutar examinator om anpassad eller alternativ examination.

## Kursvärdering

Kursvärdering genomförs under kursen eller i nära anslutning till kursens avslutning. Resultat och analys av genomförd kursvärdering ska skyndsamt återkopplas till de studenter som genomfört kursen. Studenter som deltar vid nästa kurstillfälle ska senast vid kursstart informeras om föregående kursvärderingsresultat och genomförda förändringar i kursen.

## Överlappning

Kursen kan inte ingå i examen med annan kurs, vars innehåll helt eller delvis överensstämmer med innehållet i följande kurs/kurser:  
2NA002, 2FE045:3, 1NA004:6 och 2NA01E:5 med 7,5 hp vardera. Dessutom överlappar kursen 2NA060 med 6 hp.

## Övrigt

I de fall undervisningsspråket i kursen är engelska kommer även examinationer ges på engelska.

## Kurslitteratur och övriga läromedel

### **Obligatorisk litteratur**

Bodie, Z., Kane, A. & Marcus, A. *Investments*. McGraw-Hill. Senaste upplaga. Cirka 1080 sidor.

Vetenskapliga artiklar inom finansiell ekonomi. Cirka 150 sidor.