



Linnéuniversitetet

Kalmar Växjö

Kursplan

Fakultetsnämnden för ekonomi och design
Ekonomihögskolan

2NA002 Portfolio Choice Theory, 7,5 högskolepoäng
Portfolio Choice Theory, 7.5 credits

Huvudområde

Nationalekonomi

Ämnesgrupp

Nationalekonomi

Nivå

Grundnivå

Fördjupning

G2F

Fastställande

Fastställd av Organisationskommittén 2009-11-30

Kursplanen gäller från och med höstterminen 2010

Förkunskaper

NA3001 Economics, general course, 30 Higher Education Credits (30 ECTS), and Statistics, Basic level 1, 15 Higher Education Credits (15 ECTS), or corresponding courses.

Förväntade studieresultat

Efter kursens slut ska studenten

- kunna analysera förhållanden och skeenden på finansiella marknader
- ha kunskaper om olika finansiella tillgångar, vilka risker investeringar i finansiella tillgångar medför och hur finansiella tillgångar kan användas för att skydda sig mot risker
- ha kunskaper om prisbildning på de finansiella marknaderna och om fundamentala teorier inom finansiell ekonomi
- ha kunskaper om ränteteori, portföljvalsteori och derivatteori.
- kunna beräkna finansiella samband och pris på finansiella tillgångar

Innehåll

Kursen innehåller följande moment

- 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
- Räntans bestämningsfaktorer samt avkastningskurvan
- Prissättningsmodeller för obligationer, aktier, terminer och optioner
- Lagen om ett pris, arbitrage och effektiva marknadshypotesen på de finansiella marknaderna
- Riskhantering/riskmanagement med finansiella tillgångar
- Behavioristisk finansiell ekonomi

Undervisningsformer

Undervisningen består av föreläsningar, gruppövningar, genomgång-ar i seminarieform av förelagda uppgifter. Deltagande i seminarier är obligatoriskt.

Examinationsformer

Kursen bedöms med betygen Underkänd, Godkänd eller Väl godkänd.

Bedömningen av de studerandes prestationer sker i form av skriftlig eller muntlig tentamen under kursens gång eller vid slutet av kursen. I examinationen kan även muntlig eller skriftlig redovisning av övningsuppgifter i anslutning till undervisningen ingå.

För studerande som ej blivit godkänd vid ordinarie provtillfälle ordnas förnyat prov i nära anslutning till ordinarie prov.

Betygssättning sker med något av betygen Väl Godkänd (80%-100%), Godkänd (60%-79%) eller Underkänd (0%-59%).

Kursvärdering

INGET VÄRDE ANGIVET

Kurslitteratur och övriga läromedel

Elton, Gruber, Brown and Goetzmann *Modern Portfolio Theory and Investment Analysis* (2007) 7e edition, John Wiley & sons inc.

Sidor: 700

Articles

Pages: 150