

Portföljförvaltning och alternativa investeringar, 7,5 hp
Portfolio Management and Alternative Investment, 7,5 HE credits

Beslutad: 2022-06-02

Beslutande: Institutionen för Ekonomi och IT

Gäller från: H22

Kursens mål

Kursen behandlar egenskaperna hos enskilda värdepapper samt hur man teoretiskt och praktiskt optimalt kombinerar värdepapper i portföljer. Kursen presenterar de viktigaste verktygen för alternativa investeringar och portföljförvaltning.

Efter avslutad kurs ska studenten kunna:

Kunskap och förståelse

- beskriva modern portföljanalys och allmän jämviktsteori
- definiera alternativa placeringar såsom hedgefonder, futures- kontrakt och andra derivatkontrakt
- förklara internationell diversifiering
- beskriva och förklara Behavioral Finance, investerares beslutsfattande och tillgångars prissättning.

Färdighet och förmåga

- tillämpa portföljoptimering
- använda moderna verktyg såsom jämviktsteori för förvaltningen av en portfölj
- hantera obligationsportföljer och använda finansiella termer och optioner

Värderingsförmåga och förhållningssätt

- värdera portföljresultat och jämföra alternativa investeringar

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 B, 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

1. Introduktion till portföljförvaltning.
2. Risk, avkastning och kvantitativ modellering.
3. Kapitalallokering och effektiv diversifiering.
4. Beteendemässiga aspekter av kapitalmarknaderna.
5. Analys av räntebärande värdepapper och portföljförvaltning.
6. Analys och portföljförvaltning av aktier.
7. Analys och portföljförvaltning av derivat.
8. Alternativa investeringar i portföljer.
9. Utvärdering av prestanda.

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

A1N - avancerad nivå, har endast kurs/er på grundnivå som förkunskapskrav

Huvudområde(n)

Nationalekonomi