



# INSTITUTIONEN FÖR NATIONALEKONOMI MED STATISTIK

## NEK308 Portföljteori, 7,5 högskolepoäng

Portfolio Investment, 7.5 credits

Grundnivå / First Cycle

---

### Fastställande

Kursplanen är fastställd av Institutionen för nationalekonomi med statistik 2019-08-07 och senast reviderad 2021-01-17. Den reviderade kursplanen gäller från och med 2021-01-18, vårterminen 2021.

*Utbildningsområde:* Samhällsvetenskapligt 100 %

*Ansvarig institution:* Institutionen för nationalekonomi med statistik

### Inplacering

Kursen är en 7,5hp fördjupningskurs i nationalekonomi på grundnivå.

Kursen kan ingå i följande program: 1) Ekonomie kandidatprogram (S1EKA), 2) Handelshögskolans ekonomprogram (S1HEG) och 3) Handelshögskolans ekonomprogram (S1HEP)

#### *Huvudområde*

Nationalekonomi

#### *Fördjupning*

G2F, Grundnivå, har minst 60 hp kurs/er på grundnivå som förkunskapskrav

### Förkunskapskrav

För tillträde till kursen krävs minst 60hp genomgångna kurser från grund- och fortsättningsnivå i nationalekonomi, varav minst 45hp skall vara med godkänt resultat. Förkunskaper motsvarande 15-högskolepoäng i statistik rekommenderas.

### Lärandemål

Efter godkänd kurs ska studenten kunna:

1. kunna förstå och beskriva de grundläggande matematiska och statistiska metoder som vanligen används av portföljförvaltare för att värdera finansiella värdepapper,

- inklusive värdering av såväl värdepapper som derivatinstrument
2. kunna förstå och beskriva centrala metoder som vanligen används av portföljförvaltare i valet av olika investeringsstrategier, inklusive metoder för att minska risken i portföljen och mäta portföljprestanda.
  3. demonstrera insikt i tillämpningen av de metoder och tekniker som används av portföljförvaltare för att förbättra förståelsen kring modern portföljförvaltning och moderna riskhanteringsmetoder.

Examensmålen för ekonomie kandidatexamen relateras till kursens lärandemål:

Examensmål	Lärandemål
Kunskap och förståelse	1+2+3
Färdigheter och förmåga	1+2
Värderingsförmåga och förhållningssätt	2+3

### Innehåll

Det övergripande målet med kursen är att ge en introduktion till grundläggande portföljteori. Här ingår bland annat CAPM och APT-analys av prissättning på tillgångar och hur det används för att utvärdera portföljens prestanda. Det är också en introduktion till värderingen av derivatinstrument, med bland annat optioner, terminer, terminskontrakt och Swappar, och deras olika användningsområden för att sprida riskerna och hur det kan användas i spekulationssyfte. I kursen ingår övningstillfällen i datorsalarna som behandlar insamling av data samt data-analys. Detta skall ge studenterna praktiska färdigheter i tillämpad portföljteori och portföljförvaltning.

### Former för undervisning

Kursens innehåll presenteras främst vid föreläsningar samt vid gruppövningar. En stor del av kunskapsinhämtningen på kursen sker genom eget arbete.

*Undervisningsspråk:* engelska

### Former för bedömning

Bedömningen baseras på salsskrivning, laborationer och obligatorisk närvaro. Student som ej närvarar vid obligatoriskt tillfälle kan för att få godkänt på kursen göra en särskild kompletteringsuppgift.

Om student som underkänts två gånger på samma examinerande moment önskar byte av examinator inför nästa examinationstillfälle, ska sådan begäran inlämnas skriftligt

till institutionen och bifallas om det inte finns särskilda skäl däremot (HF 6 kap § 22).

I det fall en kurs har upphört eller genomgått större förändringar ska student garanteras minst tre examinationstillfällen (inklusive ordinarie examinationstillfälle) under en tid av minst ett år, dock som längst två år efter det att kursen upphört/förändrats. Vad avser praktik och VFU gäller motsvarande, men med begränsning till endast ett ytterligare examinationstillfälle.

### **Betyg**

På kursen ges något av betygen Utmärkt (A), Mycket bra (B), Bra (C), Tillfredställande (D), Tillräcklig (E) och Underkänd (F).

### **Kursvärdering**

Kursvärdering sker digitalt och anonymt via delkursens hemsida i anslutning till ett undervisningstillfälle. Studenterna kan även fylla i enkäten vid senare tillfälle.

Enkätmaterialen sammanställs och behandlas på kursnämnd, där resultatet från kursvärderingen och förslag på eventuella förbättringsåtgärder diskuteras. Resultatet av kursvärderingen anslås på kurshemsidan för respektive delkurs när kursvärderingen är avslutad.

Om en förändring av kursen görs baserat på kursvärderingen ska detta kommuniceras vid kursintroduktionen för de studenter som ska påbörja kursen vid nästa kurstillfälle.

### **Övrigt**

1. Övergångsregler: kursen ersätter delkursen "Portföljteori, 7,5hp" inom kursblocket "NEG300".
2. Begränsningar: Kursen får inte ingå i samma examen som delkursen "Portföljteori, 7,5hp" som ingår i NEG300, NE0300, liksom HNF635.