



## KURSPLAN

### Tillämpad investeringsanalys Applied Investment Analysis 7,5 högskolepoäng (7.5 credits)

**Kurskod:** IY2623

**Huvudområde:** Industriell ekonomi och management

**Utbildningsområde:** Teknik

**Utbildningsnivå:** Avancerad nivå

**Fördjupning:** AIF - Avancerad nivå, har kurs/er på avancerad nivå som förkunskapskrav

**Ämnesgrupp:** Industriell ekonomi och organisation

**Undervisningsspråk:** Engelska

**Gäller från:** 2019-11-01

**Fastställd:** 2019-10-25

#### 1. Beslut

Denna kurs är inrättad av dekan 2019-10-17. Kursplanen är fastställd av prefekten vid institutionen för industriell ekonomi 2019-10-25 och gäller från 2019-11-01.

#### 2. Förkunskapskrav

För tillträde till kursen krävs genomgången kurs i Investeringar, risk och osäkerhet 7,5 hp.

#### 3. Syfte och innehåll

##### 3.1 Syfte

Denna kurs fördjupar analysen om hur ekonomisk risk kan hanteras med hjälp av finansiella derivat och reala optioner samt med hjälp av portföljvalsteori. Kursen vidareutvecklar förståelsen för hur kapitalmarknader fungerar men fokus ligger på relationen mellan kapitalmarknader och företag i ekonomiskt värdeskapande samt hantering av risk och osäkerhet. Övergripande syfte för kursen är att utveckla kunskaper i empirisk tillämpning av metoder och modeller.

##### 3.2 Innehåll

Empirisk analys av marknadseffektivitet

- Skattning av riskmodeller
- Tillämpning av tillgångsprissättning
- Empirisk portföljvalsanalys
- Investerings effektivitet
- Kapitalstrukturanalys

#### 4. Lärandemål

Följande lärandemål examineras i kursen:

##### 4.1 Kunskap och förståelse

Efter genomförd kurs ska studenten:

- kunna empiriskt estimerar och tolka centrala parametrar i linjära och icke-linjära riskmodeller
- förstå relationen mellan finansiering, investering och ekonomisk avkastning
- kunna estimerar bolagsstyrningens roll för företagets prestation
- värdera den ekonomiska effekten av olika nyheter
- kunskap kring relationen mellan finansiering/investering och ekonomisk hållbarhet
- kunna omsätta teoretiska modeller till empiriska analyser

##### 4.2 Färdighet och förmåga

Efter genomförd kurs ska studenten:

- analysera ett företags finansiella förhållanden utifrån ett hållbarhetsperspektiv
- kunna syntetisera empiriska resultat relativt teoretiska argument
- kunna akademiskt argumentera i tal och skrift

#### 4.3 Värderingsförmåga och förhållningssätt

Efter genomförd kurs ska studenten:

- visa förståelse för hur empirisk forskning bedrivs inom finansiell ekonomi utifrån god akademisk standard

#### 5. Läraktiviteter

Läraktiviteter i kursen består av föreläsningar och handledning. I momentet opposition ingår också presentation av det egna arbetet som någon opponerar på. Kursen examineras kontinuerligt genom de olika utbildningsmomenten.

#### 6. Bedömning och examination

Examinationsmoment för kursen

| Kod  | Benämning         | Omfattning | Betyg |
|------|-------------------|------------|-------|
| I910 | Inlämningsuppgift | 5 hp       | AF    |
| I920 | Opposition        | 2,5 hp     | GU    |

Kursen bedöms med betygen A Utmärkt, B Mycket bra, C Bra, D Tillfredsställande, E Tillräckligt, FX Underkänd, något mer arbete krävs, F Underkänd.

I kurstillfällets kurs-PM framgår i vilka examinationsmoment som kursens lärandemål examineras samt gällande bedömningsgrunder.

Examinator kan, efter samråd med högskolans FUNKA-samordnare, fatta beslut om anpassad examinationsform för att en student med varaktig funktionsvariation ska ges en likvärdig examination jämfört med en student utan funktionsvariation.

#### 7. Kursvärdering

Kursvärdering ska göras i enlighet med BTH:s beslut om frågeställning i kursvärderingar och beslut om process för hantering och uppföljning av kursvärderingar.

#### 8. Begränsningar i examen

Kursen kan ingå i examen men inte tillsammans med annan kurs vars innehåll, helt eller delvis, överensstämmer med innehållet i denna kurs.

#### 9. Kurslitteratur och övriga lärresurser

Luenberger, D. G. "Investment Science" (senaste upplagan), Oxford University Press

Baddelay, M. C. Investment: Theories and Analysis. (senaste upplagan). Palgrave

Tsay, R.S. "An introduction to analysis of financial data with R" (senaste upplagan), Wiley

Dessutom ingår vetenskapliga studier, rapporter och annat material om maximalt 500 sidor.