



GRA 6531 Portfolio Management

Studium

Master i finans, Master i økonomi og ledelse - Siviløkonom, Master i økonomi og ledelse - Siviløkonom (Finance), Specialization Course

Kursansvarlig

Bruno Gerard

Institutt

Institutt for finans

Semester

Se studieplan for aktuelt studium

Studiepoeng

6

Undervisningsspråk

Engelsk

Innledning

The course is taught in English, please see the English course description.

Læringsmål

Forkunnskaper

Bachelorgrad som kvalifiserer til opptak til studiet. I tillegg kan kurs i andre, tredje og/eller fjerde semester ha egne forkunnskapskrav og gå ut ifra at studenter har fulgt normal studieplan. For studenter på utveksling eller i gradssamarbeid vil tilsvarende kurs bli godkjent.

Obligatorisk litteratur

Bøker:

Litterman, Bob and the Quantitative Resources Group, GSAM. 2003. Modern investment management : an equilibrium approach. Wiley

Annet:

Diverse authors. Cases in portfolio management. Course specific case book available from XANEDU.com (NEW selection of cases each year - do not purchase previous year case book)

During the course there may be hand-outs and other material on additional topics relevant for the course and the examination.

Further readings and handouts may be assigned during the course and may be relevant for the final examination

Anbefalt litteratur

Bøker:

Bodie, Zvi, Alex Kane, Alan J. Marcus. 2014. Investments. 10th global ed. McGraw-Hill Education

Campbell, John Y., Luis M. Viceira. 2002. Strategic asset allocation : portfolio choice for long-term investors. Oxford University Press

Edwin Elton, Martin Gruber, Stephen Brown and William Goetzmann. 2014. Modern Portfolio Theory and Investment Analysis. 9E. Wiley

Grinold, Richard C., Ronald N. Kahn. 2000. Active portfolio management : a quantitative approach for providing superior returns and controlling risk. 2nd ed. McGraw-Hill

Emneoversikt

Dataverktøy

Læreprosess og tidsbruk

Eksamen

Vurderingsform	Vekting	Gruppestørrelse

Eksamenskode(r)

Hjelpemidler til eksamen

Under punktet eksamensinformasjon i studiehåndboken på web, @bi, finnes det definisjoner av hjelpemidler ved skriftlig skoleeksamen. Legg særlig merke til bruk av kalkulator og ordbok.

Kontinuasjon

Kontinuasjon avholdes ved neste ordinære eksamen. Dersom det er devalueringer i kurset, og devalueringene har separate eksamenskoder kan hver av disse deksamene kontinueres i. Ved en eksamenskode må hele kurset tas på nytt dersom man ønsker å kontinuere. Ved kontinuasjonseksamen vil det påløpe kontinuasjonsavgift. Vær oppmerksom på at du må kontinuere i den siste versjon av kurset med oppdatert pensumlitteratur og eksamenform. Studenten må gjøre seg kjent med nyeste versjon av kursbeskrivelsen.

Tilleggsinformasjon

Akademisk redelighet. Tillit og redelighet er avgjørende for all akademisk virksomhet. Å vise akademisk redelighet er faglige ansattes og studenters ansvar, og prinsippene er nedfelt i BIs regelverk. Notater, oppgaver eller personlige konsultasjoner basert på tidligere semesters arbeid må ikke benyttes. Alle oppgaver som leveres inn kan bli skannet for plagiering gjennom Ephorus i It's learning. Brudd på regelverket vil håndteres i henhold til BIs Forskrift om studier og eksamen. Ta kontakt dersom du har spørsmål om prinsippene for akademisk redelighet. Alle kurs ved BI benytter læringsplattform tilknyttet kursgjennomføringen. For tiden er BIs læringsplattform It's Learning. Det forventes at alle studenter benytter It's learning i kursgjennomføringen.