

Investeringsanalys 130308

Kort introduktion till ämnet i introduktionsfasen av arbete med kandidatuppsatser
Av Peter Lohmander

Teori

Motiv för investeringsanalys

Avgränsningar (kan skifta starkt)

Kapitalmarknadens relevans

Information (perfekt eller ej), risk och osäkerhet, investeringar i ett eller flera steg, möjligheter att anpassa åtgärder till stegvis uppdaterad information, ...

Värdet av flexibla investeringar

Varför nuvärde?

Varför strävan efter maximalt nuvärde?

Prioritering via nuvärde eller internränta?

Investeringsintensiteten och konsekvenser av alternativa prioriteringsmetoder

Övning

Ni har definierat preliminära versioner av Era försöksplaner inför Era kandidatarbeten.

Välj ett av de problem inom Ert arbete som på något sätt berör åtgärder med konsekvenser över tiden. Försök att definiera ett eller flera investeringsproblem av direkt relevans för Ert kommande arbete med kandidatuppsatsen!

Försök att göra detta så grundligt som möjligt och gör definitionerna begripliga för utomstående personer.

Förbered en kort genomgång för hela gruppen på whiteboard.

Grundlig Generell Litteratur

- Ba Baumol, W., Economic Theory and Operations Analysis, 4 ed., 1976.
- Bl Blanchard, P., Devaney, R.L., Hall, G.H., Differential Equations, Thomson Brooks/Cole, ISBN 0-495-01265-3, 2006
- Se Sethi, S. P., Thompson, G.L., Optimal Control Theory, Applications to Management Science and Economics, Kluwer Academic Publishers, 2 ed., 2000
- Wi1 *** Winston, W.L., Operations Research, Applications and Algorithms, Duxbury Press, International Thomson Publishing, ISBN 0-534-20971-8, 2004
- Wi2 Winston, W.L., Introduction to Probability Models, Operations Research: Volume Two, Duxbury, Thomson Brooks/Cole, ISBN 0-534-42339-0, 2004

Grundlig Kurs: Optimization in Dynamic and Stochastic Decision Problems (Fall 2013),
<http://www-sekon.slu.se/~cala/forskarutbildning/forskarutbildning/PFG0039.html>,
http://www.lohmander.com/ODSDP_2011/ODSDP_2011.pdf