

TEKX04-21-04

Risicanalys investmentbolag

Problem: Problemet som ska undersökas är hur två eller fler svenska investmentbolag ser ut ur ett riskperspektiv.

Syfte: Syftet med studien är att undersöka investmentbolagens risker i de underliggande innehaven. Framförallt kommer en jämförelse mellan de två bolagen ske men även enskilda riskanalyser.

Metod: Studien ska innefatta både en kvalitativ samt en kvantitativ del. I den kvantitativa delen undersöks historiska börskurser för de underliggande innehaven. Denna del avgränsas antagligen till de båda bolagens noterade innehav för att få nog med data att arbeta med. Genom att studera de historiska börskurserna kan exempelvis beroenden mellan innehav, Value at Risk samt Expected Shortfall beräknas och analyseras.

En kvalitativ del baseras snarare på de enskilda bolagens egenskaper, såsom branscher och branschspridning. I denna del kan även onoterade bolag innefattas.

Prioriterad Avdelning

Entrepreneurship and Strategy

Förvalda deltagare:

Olle Forsberg
Johan Lidal
Viktor Wramdemark

Contact TME: Erik Bohlin, Examinator, Avd STS