

# DERS TANITIM ve UYGULAMA BİLGİLERİ

| Dersin Adı                          | Kodu  | Yarıyıl | T+U+L<br>(saat/hafta) | Türü (Z / S) | Yerel Kredi | AKTS |
|-------------------------------------|---|---------|-----------------------|--------------|-------------|------|
| Portföy Yönetimi ve Analizi         | ITF 413   | Güz     | 03+00+00              | Seçmeli      | 3           | 6    |
| Akademik Birim:                     | Uluslararası Ticaret ve Finansman   |         |                       |              |             |      |
| Öğrenim Türü:                       | Örgün Eğitim  |         |                       |              |             |      |
| Ön Koşullar                         | yok   |         |                       |              |             |      |
| Öğrenim Dili:                       | İngilizce   |         |                       |              |             |      |
| Dersin Düzeyi:                      | Lisans  |         |                       |              |             |      |
| Dersin Koordinatörü:                | - -   |         |                       |              |             |      |
| Dersin Amacı:                       | Bu ders öğrencilere varlık yönetimi, modern portföy teorisi ve sabit getirili portföy yönetim stratejilerini CAPM, arbitraj fiyatlandırma teorisini sunmak için tasarlanmıştır. Davranışsal finans kavramları, rasyonel yatırımcı davranışları, küresel varlık dağılımı ve varlık yönetimi finans sektörü uygulamaları da bu derste işlenecektir. Sayısal modeller Excel yazılımı ile öğretilecektir.   |         |                       |              |             |      |
| Dersin İçeriği:                     | Bu ders öğrencilere varlık yönetimi, modern portföy teorisi ve portföy yönetim stratejilerini öğretmek için tasarlanmıştır.   |         |                       |              |             |      |
| Dersin Öğrenme Çıktıları (ÖÇ):      | <ul style="list-style-type: none"><li>1- Yatırımcıların risk / getiri profilini tanımlamayı öğretmek.</li><li>2- Öğrencilere varlık yönetimi sürecini ve davranışsal finans kavramlarını öğretmek.</li><li>3- Modern portföy teorilerini tanıtmak (Markowitz ve Sharpe gibi).</li><li>4- Öğrencilere portföy yönetimi doğrusal programlama ve formül planlarının kullanımını öğretmek.</li><li>5- Sabit getirili portföy yönetiminin ortalama vade, faiz değişikliklerine göre etkiden arındırma ve faiz-getiri farkları kavramlarını kapsamak.</li><li>6- Öğrencilere bu teknik modelleri nasıl kullanacaklarını Excel yazılımı kullanarak öğretmek.</li></ul> |         |                       |              |             |      |
| Dersin Öğrenme Yöntem ve Teknikleri | Sınıf içi ders ve bilgisayar uygulaması, Öğrenciler bir grup projesi olarak belirlenen hisse senetlerinin portföy risk, getiri ve beta hesaplamalarını yapacaklardır. Excel kullanarak kantitatif modelleme öğretilecektir.   |         |                       |              |             |      |

## HAFTALIK PROGRAM

| Hafta | Konular   | Ön Hazırlık |
|-------|---|-------------|
| 1     | Ders Programı ve Derse Giriş                              |             |
| 2     | Giriş, Bonolar, Tahviller ve Hisse Senetleri              |             |
| 3     | Hisse Senedi Piyasaları, Kurumsal Yatırımcılar            |             |
| 4     | Kurallar ve Yatırım Etik Kuralları , Getiri Oranları      |             |
| 5     | Portföy Analizi   |             |
| 6     | Ortalama-Varyans Analizi Cesislilik                       |             |
| 7     | Vize için tekrar  |             |
| 8     | Vize  |             |
| 9     | CAPM, APT   |             |
| 10    | Etkin Piyasalar, Davranışsal Finans Konusmacı             |             |
| 11    | Davranışsal Finans  |             |
| 12    | Faiz Oranları ve Bono Değerlemesi Davranışsal Finans Özet |             |

|    |                          |  |
|----|--------------------------|--|
| 13 | Bono Analizi             |  |
| 14 | Hisse Senedi Deęerlemesi |  |

Kadir Has Üniversitesi'nde bir dönem 14 haftadır, 15. ve 16. hafta sınav haftalarıdır.

## ZORUNLU ve ÖNERİLEN OKUMALAR

Investments, 1/E Levy & Post, 2005, Financial Times Press, Published:10Nov2004 ISBN-10: 0273651641

## DİĞER KAYNAKLAR

Investments and Portfolio Management  
Bodie, Kane and Marcus Global Edition, Ninth Edition, McGraw Hill

## DEĞERLENDİRME SİSTEMİ

| Yarıyıl İçi Çalışmaları                   | Sayı     | Katkı Payı (%) |
|---|----------|----------------|
| Katılım                                   | 1        | 10             |
| Ara Sınavlar/Sözlü Sınavlar/Kısa Sınavlar | 1        | 50             |
| Final Sınavı                              | 1        | 40             |
| <b>Total:</b>                             | <b>3</b> | <b>100</b>     |

## İŞ YÜKÜ HESAPLAMASI

| Etkinlikler                               | Sayısı | Süresi (saat) | Toplam İş Yüğü (saat) |
|---|--------|---------------|-----------------------|
| Ders Saati                                | 14     | 3             | 42                    |
| Uygulama                                  | 2      | 4             | 8                     |
| Proje                                     | 1      | 20            | 20                    |
| Dersle İlgili Sınıf Dışı Etkinlikler      | 10     | 3             | 30                    |
| Ara Sınavlar/Sözlü Sınavlar/Kısa Sınavlar | 1      | 25            | 25                    |
| Final Sınavı                              | 1      | 25            | 25                    |
| <b>Toplam İş Yüğü (saat):</b>             |        |               | <b>150</b>            |

1 AKTS = 25 saatlik iş yüğü

## PROGRAM YETERLİLİKLERİ (PY) ve ÖĞRENME ÇIKTILARI (ÖÇ) İLİŞKİSİ

| #   | PY1 | PY2 | PY3 | PY4 | PY5 | PY6 | PY7 | PY8 | PY9 | PY10 |
|-----|-----|-----|-----|-----|-----|-----|-----|-----|-----|------|
| OC1 |     |     |     |     |     |     |     |     |     |      |
| OC2 |     |     |     |     |     |     |     |     |     |      |
| OC3 |     |     |     |     |     |     |     |     |     |      |
| OC4 |     |     |     |     |     |     |     |     |     |      |
| OC5 |     |     |     |     |     |     |     |     |     |      |
| OC6 |     |     |     |     |     |     |     |     |     |      |

**Katkı Düzeyi:** 1 Düşük, 2 Orta, 3 Yüksek