DERS TANITIM ve UYGULAMA BİLGİLERİ

Dersin Adı	Kodu	Yarıyıl	T+U+L (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 fiyatlama 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):	• **1-** Yatırımcıların risk / getiri profilini tanımlamayi öğretmek. • **2-** Öğrencilere varlık yönetimi sürecini ve davranışsal finans kavramlarını öğretmek. • **3-** Modern portföy teorilerini tanıtmak (Markowitz ve Sharpe gibi). • **4-** Öğrencilere portföy yönetimi doğrusal programlama ve formül planlarının kullanımını öğretmek. • **5-** Sabit getirili portföy yönetiminin ortalama vade, faiz değişikliklerine göre etkiden arındırma ve faiz-getiri farkları kavramlarını kapsamak. • **6-** Öğrencilere bu teknik modelleri nasıl kullanacaklarını Excel yazılımı kullanarak öğretmek.
Dersin Öğrenme Yöntem ve Teknikleri	Sınıf içi ders ve bilgisayar uygulaması, Öğrenciler bir grup projesi olarak belirlenen hisse senetlerinin portföy risk, getiri ve beta hesaplamalarini yapacaklardir. Excel kullanarak kantitatif modelleme öğretilecektir.

HAFTALIK PROGRAM

Hafta	Konular	Ön Hazırlık
1	Ders Programı ve Derse Giris	
2	Giris, Bonolar, Tahviller ve Hisse Senetleri	
3	Hisse Senedi Piyasalari, Kurumsal Yatirimcilar	
4	Kurallar ve Yatırım Etik Kuralları , Getiri Oranlari	
5	Portföy Analizi	
6	Ortalama-Varyans Analizi Cesitlilik	
7	Vize için tekrar	
8	Vize	
9	CAPM, APT	
10	Etkin Piyasalar, Davranışsal Finans Konusmaci	
11	Davranışsal Finans	
12	Faiz Oranlari ve Bono Degerlemesi Davranışsal Finans Özet	

13	Bono Analizi	
14	Hisse Senedi Değerlemesi	

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
Total:	**3**	**100**

İŞ YÜKÜ HESAPLAMASI

Etkinlikler	**Sayısı**	**Süresi (saat)**	**Toplam İş Yükü (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
Toplam İş Yükü (saat):			**150**

1 AKTS = 25 saatlik iş yükü

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