

# 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	Zorunlu	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 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
<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 yükü

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

#	PY1	PY2	PY3	PY4	PY5	PY6	PY7	PY8	PY9	PY10	PY11	PY12
OC1		3	3	2	2	1	1	3	3	3	3	
OC2		3	3	2	2	1		3	3	3	3	
OC3		3	3	2	2			3	3	3	3	
OC4	3	3	3	2	2			3	3	3	3	
OC5	3	3	3	2	2		1	3	3	3	3	1
OC6	3	3			2		1	3	3	3	3	1

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