

İçerik

Ders Kodu	Dersin Adı	Yarıyıl	Teori	Uygulama	Lab	Kredisi	AKTS
G451	Portföy Yönetimi	5	3	0	0	3	5

Ön Koşul	G352
Derse Kabul Koşulları	G352

Dersin Dili	İngilizce
Türü	Seçmeli
Dersin Düzeyi	Lisans
Dersin Amacı	Bu dersin amacı, öğrencilerin finansal piyasaları, kurumları ve yatırım araçlarını tanıyarak portföy oluşturma, yönetme ve performans değerlendirme becerileri kazanmalarını sağlamaktır. Öğrenciler, temel teorik modelleri öğrenmenin yanı sıra farklı portföy stratejilerini ve risk yönetimi uygulamalarını inceleyerek yatırım kararlarında analitik ve eleştirel bir bakış açısı geliştireceklerdir.
İçerik	1) Portföy yönetimine giriş 2) Finansal piyasalar ve kurumlar ile piyasa mikro yapısı 3) Fiyatlama temelleri, risk ve getiri 4) Finansal enstrümanlar 1: Tahviller ve hisse senetleri 5) Finansal enstrümanlar 2: Yatırım fonları ve ETF'ler 6) Ara sınav 7) Portföy teorisi 8) Finansal varlık fiyatlama modeli ve çok faktörlü modeller 9) Portföy yönetiminde uygulamalar 1: Pasif vs. aktif yatırım, varlık tahsisi 10) Portföy yönetiminde uygulamalar 2: Faktör stratejileri, ampirik bulgular, anomaliler 11) Portföy yönetiminde uygulamalar 3: Teknik analiz, nötr stratejiler, ESG yatırımı 12) Portföy performansının ölçülmesi 13) Türev araçlar ve portföy risk yönetimi 14) Öğrenci sunumu
Kaynaklar	- Bodie, Z., Kane, A., & Marcus, A. J. (2023). Investments, (13th ed.). McGraw Hill LLC. - Reilly, F. K., Brown, K. C., & Leeds, S. J. (2019). Investment Analysis and Portfolio Management, (11th ed.). Cengage Learning. - Bolak, M. (2001). Sermaye Piyasası, Menkul Kıymetler ve Portföy Analizi, 4.basım. Beta Basım.

Teori Konu Başlıkları

Hafta	Konu Başlıkları
1	Portföy yönetimine giriş
2	Finansal piyasalar ve kurumlar ile piyasa mikro yapısı
3	Fiyatlama temelleri, risk ve getiri
4	Finansal enstrümanlar 1: Tahviller ve hisse senetleri
5	Finansal enstrümanlar 2: Yatırım fonları ve ETF'ler
6	Ara sınav
7	Portföy teorisi
8	Finansal varlık fiyatlama modeli ve çok faktörlü modeller
9	Portföy yönetiminde uygulamalar 1: Pasif vs. aktif yatırım, varlık tahsisi
10	Portföy yönetiminde uygulamalar 2: Faktör stratejileri, ampirik bulgular, anomaliler

Hafta	Konu Başlıkları
11	Portföy yönetiminde uygulamalar 3: Teknik analiz, nötr stratejiler, ESG yatırımı
12	Portföy performansının ölçülmesi
13	Türev araçlar ve portföy risk yönetimi
14	Öğrenci sunumu