

GENEL TANIM / GENERAL DESCRIPTION

Ders Adı / Course Name	Applied Active and Passive Management / Applied Active and Passive Management	
Ders Kodu / Course Code	FNB506	
Ders Türü / Course Type		
Ders Seviyesi / Course Level	Master without Thesis / Master without Thesis	
Ders Akts Kredi / ECTS	6.00	
Haftalık Ders Saati (Kuramsal) / Course Hours For Week (Theoretical)	3.00	
Haftalık Uygulama Saati / Course Hours For Week (Objected)	0.00	
Haftalık Laboratuar Saati / Course Hours For Week (Laboratory)	0.00	
Dersin Verildiği Yıl / Year	1	
Öğretim Sistemi / Teaching System		
Eğitim Dili / Education Language		
Ön Koşulu Olan Ders(ler) / Precondition Courses	yok	none
Amacı / Purpose	Bu dersin amacı, öğrencilere aktif ve pasif portföy yönetimi kavramlarını, stratejilerini ve uygulamalarını öğretmek ve finansal piyasalarda etkili bir şekilde aktif veya pasif yönetim yapabilmeleri için gereken becerileri kazandırmaktır.	The aim of this course is to teach students the concepts, strategies, and applications of active and passive portfolio management and to equip them with the necessary skills to effectively engage in active or passive management in financial markets.
İçeriği / Content	Bu dersin amacı, öğrencilere aktif ve pasif portföy yönetimi kavramlarını, stratejilerini ve uygulamalarını öğretmek ve finansal piyasalarda etkili bir şekilde aktif veya pasif yönetim yapabilmeleri için gereken becerileri kazandırmaktır.	The aim of this course is to teach students the concepts, strategies, and applications of active and passive portfolio management and to equip them with the necessary skills to effectively engage in active or passive management in financial markets.
Önerilen Diğer Hususlar / Recommended Other Considerations		
Staj Durumu / Internship Status		
Kitabı / Malzemesi / Önerilen Kaynaklar / Books / Materials / Recommended Reading	1Grinold, R., & Kahn, R. (2000). Active Portfolio Management: A Quantitative Approach for Producing Superior Returns and Controlling Risk (2nd Edition). McGraw-Hill.	1Grinold, R., & Kahn, R. (2000). Active Portfolio Management: A Quantitative Approach for Producing Superior Returns and Controlling Risk (2nd Edition). McGraw-Hill.
Öğretim Üyesi (Üyeleri) / Faculty Member (Members)		

ÖĞRENME ÇIKTILARI / LEARNING OUTCOMES

1	Aktif ve pasif yönetimi kavramlarını anlama.	Understand the concepts of asset and liability management.
2	Aktif ve pasif yönetim stratejilerini geliştirme becerisi kazanma.	Develop the ability to create asset and liability management strategies.
3	Finansal risklerin yönetimi ve dengeleme süreçlerini analiz etme yeteneği geliştirme.	Analyze the management and balancing processes of financial risks.
4	Aktif pasif yönetimi uygulamalarını değerlendirme becerisi geliştirme.	Evaluate the applications of asset liability management.
5	Uygulamalı aktif pasif yönetimiyle ilgili araştırma yapma ve sonuçlarını yazılı veya sözlü olarak sunma becerisi geliştirme.	Develop the ability to conduct research on applied asset liability management and present its findings.

HAFTALIK DERS İÇERİĞİ / DETAILED COURSE OUTLINE

Hafta / Week					
1	Teorik Dersler / Theoretical	Uygulama	Lab	Öğretim Yöntem ve Teknikleri/Teaching Methods Techniques	Ön Hazırlık / Preliminary
	Aktif ve Pasif Yönetim Kavramları				
	Concepts of Active and Passive Management				
2	Teorik Dersler / Theoretical	Uygulama	Lab	Öğretim Yöntem ve Teknikleri/Teaching Methods Techniques	Ön Hazırlık / Preliminary
	Portföy Yatırım Süreci ve Hedef Belirleme				
	Portfolio Investment Process and Goal Setting				
3	Teorik Dersler / Theoretical	Uygulama	Lab	Öğretim Yöntem ve Teknikleri/Teaching Methods Techniques	Ön Hazırlık / Preliminary
	Aktif Yönetimde Hisse Senedi Seçimi ve Analizi				
	Stock Selection and Analysis in Active Management				
4	Teorik Dersler / Theoretical	Uygulama	Lab	Öğretim Yöntem ve Teknikleri/Teaching Methods Techniques	Ön Hazırlık / Preliminary
	Aktif Yönetimde Tahvil Seçimi ve Analizi				
	Bond Selection and Analysis in Active Management				
5	Teorik Dersler / Theoretical	Uygulama	Lab	Öğretim Yöntem ve Teknikleri/Teaching Methods Techniques	Ön Hazırlık / Preliminary
	Pasif Yönetimde Endeks Fonları ve ETF'ler				
	Index Funds and ETFs in Passive Management				

6	Teorik Dersler / Theoretical	Uygulama	Lab	Öğretim Yöntem ve Teknikleri/Teaching Methods Techniques	Ön Hazırlık / Preliminary
	Pasif Yönetimde Portföy İzleme ve Yeniden Dengeleme				
	Portfolio Tracking and Rebalancing in Passive Management				
7	Teorik Dersler / Theoretical	Uygulama	Lab	Öğretim Yöntem ve Teknikleri/Teaching Methods Techniques	Ön Hazırlık / Preliminary
	Aktif ve Pasif Yönetimde Sektör Rotasyonu				
	Sector Rotation in Active and Passive Management				
8	Teorik Dersler / Theoretical	Uygulama	Lab	Öğretim Yöntem ve Teknikleri/Teaching Methods Techniques	Ön Hazırlık / Preliminary
	Aktif ve Pasif Yönetimde Risk Yönetimi ve Performans Ölçümü				
	Risk Management and Performance Measurement in Active and Passive Management				
9	Teorik Dersler / Theoretical	Uygulama	Lab	Öğretim Yöntem ve Teknikleri/Teaching Methods Techniques	Ön Hazırlık / Preliminary
	Aktif ve Pasif Yönetimde Makroekonomik Analiz				
	Macroeconomic Analysis in Active and Passive Management				
10	Teorik Dersler / Theoretical	Uygulama	Lab	Öğretim Yöntem ve Teknikleri/Teaching Methods Techniques	Ön Hazırlık / Preliminary
	Aktif ve Pasif Yönetimde Stil Analizi ve Faktör Modelleri				
	Style Analysis and Factor Models in Active and Passive Management				
11	Teorik Dersler / Theoretical	Uygulama	Lab	Öğretim Yöntem ve Teknikleri/Teaching Methods Techniques	Ön Hazırlık / Preliminary
	Aktif ve Pasif Yönetimde Kâr Dağılımı ve Vergi Optimizasyonu				
	Profit Distribution and Tax Optimization in Active and Passive Management				

12	Teorik Dersler / Theoretical	Uygulama	Lab	Öğretim Yöntem ve Teknikleri/Teaching Methods Techniques	Ön Hazırlık / Preliminary
	Sosyal Sorumluluk ve ESG Faktörleri				
	Social Responsibility and ESG Factors				
13	Teorik Dersler / Theoretical	Uygulama	Lab	Öğretim Yöntem ve Teknikleri/Teaching Methods Techniques	Ön Hazırlık / Preliminary
	Aktif ve Pasif Yönetimde Yönetim Ücretleri ve Maliyetler				
	Management Fees and Costs in Active and Passive Management				
14	Teorik Dersler / Theoretical	Uygulama	Lab	Öğretim Yöntem ve Teknikleri/Teaching Methods Techniques	Ön Hazırlık / Preliminary
	Aktif ve Pasif Yönetimde Güncel Konular ve Trendler				
	Current Issues and Trends in Active and Passive Management				

DEĞERLENDİRME / EVALUATION

Yarıyıl (Yıl) İçi Etkinlikleri / Term (or Year) Learning Activities	Sayı / Number	Katkı Yüzdesi / Percentage of Contribution (%)
Ara Sınav / Midterm Examination	1	100
Toplam / Total:	1	100
Başarı Notuna Katkı Yüzdesi / Contribution to Success Grade(%):		40

Yarıyıl (Yıl) Sonu Etkinlikleri / End Of Term (or Year) Learning Activities	Sayı / Number	Katkı Yüzdesi / Percentage of Contribution (%)
Final Sınavı / Final Examination	1	100
Toplam / Total:	1	100
Başarı Notuna Katkı Yüzdesi / Contribution to Success Grade(%):		60

Etkinliklerinin Başarı Notuna Katkı Yüzdesi(%) Toplamı / Total Percentage of Contribution (%) to Success Grade:		100
Değerlendirme Tipi / Evaluation Type:		

İŞ YÜKÜ / WORKLOADS

Etkinlikler / Workloads	Sayı / Number	Süresi (Saat) / Duration (Hours)	Toplam İş Yüğü (Saat) / Total Work Load (Hour)
Ara Sınav / Midterm Examination	6	10.00	60.00
Final Sınavı / Final Examination	6	15.00	90.00
Toplam / Total:	12	25.00	150.00
Dersin AKTS Kredisi = Toplam İş Yüğü (Saat) / 25.00 (Saat/AKTS) = 150.00/25.00 = 6.00 ~ 6.00 / Course ECTS Credit = Total Workload (Hour) / 25.00 (Hour / ECTS) = 150.00 / 25.00 = 6.00 ~ 6.00			

PROGRAM VE ÖĞRENME ÇIKTISI / PROGRAM LEARNING OUTCOMES

Öğrenme Çıktıları / Learning Outcomes	Program Çıktıları / Program Outcomes														
	1.1.1	1.1.2	1.1.3	1.1.4	1.1.5	1.1.6	1.1.7	1.1.8	1.1.9	1.1.10	1.1.11	1.1.12	1.1.13	1.1.14	1.1.15
1.Aktif ve pasif yönetimi kavramlarını anlama. / Understand the concepts of asset and liability management.	4	5	5	5	4	4	5	5	4	5	5	4	5	4	4
2.Aktif ve pasif yönetim stratejilerini geliştirme becerisi kazanma. / Develop the ability to create asset and liability management strategies.	4	4	5	5	5	4	4	4	4	5	5	5	5	4	4
3.Finansal risklerin yönetimi ve dengeleme süreçlerini analiz etme yeteneği geliştirme. / Analyze the management and balancing processes of financial risks.	4	5	5	5	4	5	5	4	4	5	5	5	4	4	5
4.Aktif pasif yönetimi uygulamalarını değerlendirme becerisi geliştirme. / Evaluate the applications of asset liability management.	5	4	5	5	5	4	4	5	5	4	4	5	5	4	4
5.Uygulamalı aktif pasif yönetimiyle ilgili araştırma yapma ve sonuçlarını yazılı veya sözlü olarak sunma becerisi geliştirme. / Develop the ability to conduct research on applied asset liability management and present its findings.	4	4	4	5	4	5	4	5	4	5	4	5	4	5	4

Katkı Düzeyi / Contribution Level : 1-Çok Düşük / Very low, 2-Düşük / Low, 3-Orta / Moderate, 4-Yüksek / High, 5-Çok Yüksek / Very high