

GENEL TANIM / GENERAL DESCRIPTION

Ders Adı / Course Name	Portfolio Management / Portfolio Management	
Ders Kodu / Course Code	MHD517	
Ders Türü / Course Type		
Ders Seviyesi / Course Level	Master with Thesis / Master with 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 Laboratuvar Saati / Course Hours For Week (Laboratory)	0.00	
Dersin Verildiği Yıl / Year	1	
Öğretim Sistemi / Teaching System	Daytime Class / Daytime Class	
Eğitim Dili / Education Language	Turkish / Turkish	
Ön Koşulu Olan Ders(ler) / Precondition Courses	Yok	None
Amacı / Purpose	Portföy Yönetimi dersinin amacı, öğrencilere portföy yönetimi kavramlarını, tekniklerini ve stratejilerini anlatarak, yatırım kararlarını etkili bir şekilde analiz etme ve portföyleri optimize etme becerilerini geliştirmektir. Ders, risk ve getiri ilişkileri, varlık dağılımı, varlık seçimi, performans ölçümü, portföy optimizasyonu ve alternatif yatırımlar gibi konuları kapsar. Ayrıca, öğrencilere sosyal sorumluluk temelli yatırımlar ve gelecekteki trendler hakkında bilgi verilir. Dersin sonunda, öğrenciler portföy yönetimi alanında temel bir anlayışa sahip olmalı ve gerçek dünyadaki portföy yönetimi uygulamalarını anlayıp değerlendirebilmelidir.	The objective of the course "Portfolio Management" is to provide students with an understanding of portfolio management concepts, techniques, and strategies, and to develop their skills in effectively analyzing investment decisions and optimizing portfolios. The course covers topics such as risk and return relationships, asset allocation, security selection, performance measurement, portfolio optimization, and alternative investments. Additionally, students are introduced to socially responsible investing and future trends in the field. By the end of the course, students should have a foundational understanding of portfolio management and be able to comprehend and evaluate real-world portfolio management practices.
İçeriği / Content	Portföy Yönetimi dersinin amacı, öğrencilere portföy yönetimi kavramlarını, tekniklerini ve stratejilerini anlatarak, yatırım kararlarını etkili bir şekilde analiz etme ve portföyleri optimize etme becerilerini geliştirmektir. Ders, risk ve getiri ilişkileri, varlık dağılımı, varlık seçimi, performans ölçümü, portföy optimizasyonu ve alternatif yatırımlar gibi konuları kapsar. Ayrıca, öğrencilere sosyal sorumluluk temelli yatırımlar ve gelecekteki trendler hakkında bilgi verilir. Dersin sonunda, öğrenciler portföy yönetimi alanında temel bir anlayışa sahip olmalı ve gerçek dünyadaki portföy yönetimi uygulamalarını anlayıp değerlendirebilmelidir.	The objective of the course "Portfolio Management" is to provide students with an understanding of portfolio management concepts, techniques, and strategies, and to develop their skills in effectively analyzing investment decisions and optimizing portfolios. The course covers topics such as risk and return relationships, asset allocation, security selection, performance measurement, portfolio optimization, and alternative investments. Additionally, students are introduced to socially responsible investing and future trends in the field. By the end of the course, students should have a foundational understanding of portfolio management and be able to comprehend and evaluate real-world portfolio management practices.
Önerilen Diğer Hususlar / Recommended Other Considerations	Bulunmamaktadır	Not available
Staj Durumu / Internship Status	Staj durumu bulunmamaktadır	There is no internship status

Kitabı / Malzemesi / Önerilen Kaynaklar / Books / Materials / Recommended Reading	Bodie, Z., Kane, A., & Marcus, A. J. (2014). Investments (10th ed.). Elton, E. J., Gruber, M. J., Brown, S. J., & Goetzmann, W. N. (2019). Modern Portfolio Theory and Investment Analysis (10th ed.). Fabozzi, F. J., & Markowitz, H. M. (2011). The Theory and Practice of Investment Management: Asset Allocation, Valuation, Portfolio Construction, and Strategies (2nd ed.). Reilly, F.	Bodie, Z., Kane, A., & Marcus, A. J. (2014). Investments (10th ed.). Elton, E. J., Gruber, M. J., Brown, S. J., & Goetzmann, W. N. (2019). Modern Portfolio Theory and Investment Analysis (10th ed.). Fabozzi, F. J., & Markowitz, H. M. (2011). The Theory and Practice of Investment Management: Asset Allocation, Valuation, Portfolio Construction, and Strategies (2nd ed.). Reilly, F.
Öğretim Üyesi (Üyeleri) / Faculty Member (Members)		

ÖĞRENME ÇIKTILARI / LEARNING OUTCOMES

1	Portföy yönetimi kavramını ve temel prensiplerini anlama ve değerlendirme becerisi geliştirme.	Understand and evaluate the concept of portfolio management and its basic principles.
2	Finansal varlık seçimi ve dağılımında stratejik kararlar alabilme becerisi geliştirme.	Develop the ability to make strategic decisions in asset selection and allocation.
3	Portföy riski ve getirisi arasındaki ilişkiyi analiz etme ve değerlendirme becerisi geliştirme.	Analyze and evaluate the relationship between portfolio risk and return.
4	Portföy performansını değerlendirme ve optimize etme becerisi geliştirme.	Develop the ability to evaluate and optimize portfolio performance.
5	İleri düzey portföy yönetimi konularında güncel araştırmaları takip etme ve eleştirel bir perspektifle değerlendirme becerisi geliştirme.	Develop the ability to stay updated on current research in advanced portfolio management and evaluate it from a critical perspective.

HAFTALIK DERS İÇERİĞİ / DETAILED COURSE OUTLINE

Hafta / Week					
1	Teorik Dersler / Theoretical	Uygulama	Lab	Öğretim Yöntem ve Teknikleri/Teaching Methods Techniques	Ön Hazırlık / Preliminary
	Dersin Amacı ve Tanıtımı				
	Course Objectives and Introduction				
2	Teorik Dersler / Theoretical	Uygulama	Lab	Öğretim Yöntem ve Teknikleri/Teaching Methods Techniques	Ön Hazırlık / Preliminary
	Portföy Yönetimi Temelleri				
	Fundamentals of Portfolio Management				
3	Teorik Dersler / Theoretical	Uygulama	Lab	Öğretim Yöntem ve Teknikleri/Teaching Methods Techniques	Ön Hazırlık / Preliminary
	Risk ve Getiri İlişkisi				
	Risk and Return Relationship				
4	Teorik Dersler / Theoretical	Uygulama	Lab	Öğretim Yöntem ve Teknikleri/Teaching Methods Techniques	Ön Hazırlık / Preliminary
	Portföy Çeşitlendirme ve Varlık Dağılımı				
	Portfolio Diversification and Asset Allocation				
5	Teorik Dersler / Theoretical	Uygulama	Lab	Öğretim Yöntem ve Teknikleri/Teaching Methods Techniques	Ön Hazırlık / Preliminary
	Portföy Performans Ölçümü				
	Portfolio Performance Measurement				

6	Teorik Dersler / Theoretical	Uygulama	Lab	Öğretim Yöntem ve Teknikleri/Teaching Methods Techniques	Ön Hazırlık / Preliminary
	Stratejik Varlık Dağılımı				
	Portfolio Performance Measurement				
7	Teorik Dersler / Theoretical	Uygulama	Lab	Öğretim Yöntem ve Teknikleri/Teaching Methods Techniques	Ön Hazırlık / Preliminary
	Taktiksel Varlık Dağılımı				
	Tactical Asset Allocation				
8	Teorik Dersler / Theoretical	Uygulama	Lab	Öğretim Yöntem ve Teknikleri/Teaching Methods Techniques	Ön Hazırlık / Preliminary
	Sektörel ve Bireysel Varlık Seçimi				
	Sectorial and Individual Security Selection				
9	Teorik Dersler / Theoretical	Uygulama	Lab	Öğretim Yöntem ve Teknikleri/Teaching Methods Techniques	Ön Hazırlık / Preliminary
	Portföy Yönetiminde Faktör Modelleri				
	Factor Models in Portfolio Management				
10	Teorik Dersler / Theoretical	Uygulama	Lab	Öğretim Yöntem ve Teknikleri/Teaching Methods Techniques	Ön Hazırlık / Preliminary
	Risk Yönetimi ve Portföy Sigortası				
	Risk Management and Portfolio Insurance				
11	Teorik Dersler / Theoretical	Uygulama	Lab	Öğretim Yöntem ve Teknikleri/Teaching Methods Techniques	Ön Hazırlık / Preliminary
	Portföy Optimizasyonu ve Modern Portföy Teorisi				
	Portfolio Optimization and Modern Portfolio Theory				

12	Teorik Dersler / Theoretical	Uygulama	Lab	Öğretim Yöntem ve Teknikleri/Teaching Methods Techniques	Ön Hazırlık / Preliminary
	Alternatif Yatırımlar ve Portföy Yönetimi				
	Alternative Investments and Portfolio Management				
13	Teorik Dersler / Theoretical	Uygulama	Lab	Öğretim Yöntem ve Teknikleri/Teaching Methods Techniques	Ön Hazırlık / Preliminary
	Sosyally Responsible Investing (SRI)				
	Sosyal Sorumluluk Temelli Yatırımlar (SRI)				
14	Teorik Dersler / Theoretical	Uygulama	Lab	Öğretim Yöntem ve Teknikleri/Teaching Methods Techniques	Ön Hazırlık / Preliminary
	Portföy Yönetimi Uygulamaları ve Gelecek Trendler				
	Portfolio Management Applications and Future Trends				
15	Teorik Dersler / Theoretical	Uygulama	Lab	Öğretim Yöntem ve Teknikleri/Teaching Methods Techniques	Ön Hazırlık / Preliminary
	Final Sınavı				
	Final Exam				

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.Portföy yönetimi kavramını ve temel prensiplerini anlama ve değerlendirme becerisi geliştirme. / Understand and evaluate the concept of portfolio management and its basic principles.	5	5	5	5	5	5	5	5	5	5	5	5	5	5	5
2.Finansal varlık seçimi ve dağılımında stratejik kararlar alabilme becerisi geliştirme. / Develop the ability to make strategic decisions in asset selection and allocation.	5	5	5	5	5	5	5	5	5	5	5	5	5	5	5
3.Portföy riski ve getirisi arasındaki ilişkiyi analiz etme ve değerlendirme becerisi geliştirme. / Analyze and evaluate the relationship between portfolio risk and return.	5	5	5	5	5	5	5	5	5	5	5	5	5	5	5
4.Portföy performansını değerlendirme ve optimize etme becerisi geliştirme. / Develop the ability to evaluate and optimize portfolio performance.	5	5	5	5	4	4	4	4	5	5	4	5	5	4	4
5.İleri düzey portföy yönetimi konularında güncel araştırmaları takip etme ve eleştirel bir perspektifle değerlendirme becerisi geliştirme. / Develop the ability to stay updated on current research in advanced portfolio management and evaluate it from a critical perspective.	4	4	5	5	5	5	5	5	5	4	5	5	4	5	5

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