

Dersin Kodu: FE 542				Dersin Adı: Nitel Varlık Yönetimi			
Yarıyılı	D + U + L	Kredisi	AKTS	Dersin Dili	Dersin Türü	İşleniş Yöntemi	Ön Koşulları
1	3+0+0	3	8	İngilizce	Zorunlu		-
Dersin Amacı				Bu dersin amacı, varlık yönetimi problemleri için kullanılan kantitatif teknikleri ve bunların uygulamalarını öğretmektir.			
Dersin İçeriği				Ders, detaylı olarak varlık fiyatlama modellerini, portföy optimizasyonu ve yapılandırmasını ve eşli alım-satım ve kısa vadeli momentum alım-satım gibi dinamik stratejiler ile davranışsal finanstaki anomoliler hakkındaki stratejileri kapsamaktadır.			
Dersin Öğrenme Çıktıları				<ol style="list-style-type: none"> 1. varlık fiyatlama modelleri, 2. portföy optimizasyonu ve yapılandırması, 3. eşli alım-satım ve kısa vadeli momentum alım-satım gibi dinamik stratejiler 4. davranışsal finanstaki anomoliler hakkındaki stratejileri 5. ortak fonlar, riskten korunma fonları, elektronik fon transferleri ve özel yatırım araçlarını 6. temel alım-satım strateji türlerinin incelenmesi 			
Dersin ISCED Kategorisi				46-Matematik ve İstatistik (%50), 52-Mühendislik (%50)			
Ders Kitabı				C.Alexander, (2008). Market Risk Analysis: Quantitative Methods in Finance, Wiley. C.Alexander, (2008). Market Risk Analysis: Practical Financial Econometrics, Wiley.			
Yardımcı Kaynaklar				-			

HAFTALIK KONULAR

Hafta	Teorik Ders Konuları	Uygulama / Laboratuvar Konuları
1	Nitel Varlık Yönetimi Kavramı ve Uygulamaları	
2	Nitel Varlık Yönetimi Kavramı Ve Uygulamaları	
3	Varlık Fiyatlama Modelleri	
4	Portföy Optimizasyonu ve Yapılandırması	
5	Dinamik Stratejiler (Eşli ve Kısa Vadeli Momentum Alım Satım)	
6	Dinamik Stratejiler (Eşli ve Kısa Vadeli Momentum Alım Satım)	
7	Ara Sınav	
8	Davranışsal Finanstaki Anomoliler İçin Stratejiler	
9	Ortak Fonlar ve Riskten Korunma Fonları	
10	Ortak Fonlar ve Riskten Korunma Fonları	
11	Elektronik Fon Transferleri ve Özel Yatırım Araçları	
12	Elektronik Fon Transferleri ve Özel Yatırım Araçları	
13	Genel Değerlendirme	
14	Final Sınavı	

DERSİN DEĞERLENDİRME SİSTEMİ

	Etkinlikler	Adet	Katkı Oranı (%)
Yarıyıl İçi Çalışmaları	Kısa Sınavlar	3	35
	Dönem Ödevi / Projesi	0	0
	Raporlar	0	0
	Bitirme Tezi/Projesi	0	0
	Seminer	0	0
	Ödevler	4	40
	Sunum	0	0
	Arasınavlar	0	0
	Proje	0	0
	Laboratuvar	0	0
	Diğer	0	0
YARIYIL SONU SINAVI		1	25
Toplam		6	100

DERSİN FİNANS MÜHENDİSLİĞİ PROGRAMI KAZANIMLARINA (ÇIKTILARINA) KATKISI

	Program Kazanımları (Çıktıları)	1	2	3
1	Öğrencilerin uluslararası finansal piyasalarda yaşanan gelişmeler ve yenilikler hakkında bilgilendirilmesini sağlamak		*	
2	Türkiye'nin finansal ürün çeşitliliği ve hizmetler konusunda dünyanın en önemli merkezlerinden biri haline dönüşmesini sağlamak ve bu alanda uzman işgücünü yetiştirmek.			*
3	Yeni finansal ürünleri tasarlama, üretme ve pazarlama konusunda uzmanlık kazandırmak.	*		
4	Finansal piyasaları değerlendirmede, yatırım stratejilerini belirlemede, sigortacılık, yatırım fonları gibi farklı alanlarda risk analizleri yapmada kullanılan araç ve teknikleri öğretmek.			
5	Finansal problemler karşısında matematiksel modeller kurabilen ve bunları hesaplama yöntemleri ile çözebilen uzmanlar eğitmek			
6	Disiplinler arası çalışma ve araştırma gruplarında liderlik yapmak ve sorumluluk almak; karmaşık durumlarda stratejik çözüm yaklaşımları geliştirebilmek.	*		
7	En az 1 yabancı dili mesleki ve akademik yaşamda etkin biçimde kullanmak.	*		
8	Mesleki ve etik sorumluluk bilinci kazanmak.		*	

Katkı Derecesi: 1 düşük, 2 orta, 3 yüksek

AKTS - İŞ YÜKÜ TABLOSU

ETKİNLİKLER	Sayı	Süre (Saat)	İş Yüğü
Ders Süresi	14	3	42
Yarıyıl Sonu Sınavı (Hazırlık Süresi Dahil)	1	30	30
Kısa Sınavlar	0	0	0
Dönem Ödevi / Projesi	0	0	0
Raporlar	0	0	0
Bitirme Tezi/Projesi	0	0	0
Seminer	0	0	0
Sınıf Dışı Çalışma Süresi	14	2	28
Ödevler	4	20	80
Sunum	0	0	0
Arasınavlar (Hazırlık Süresi Dahil)	1	20	20
Proje	0	0	0
Laboratuvar	0	0	0
Toplam İş Yüğü			200
Dersin AKTS Kredisi (Toplam İş Yüğü / 25)			8

Revizyon/Tarih 20.12.2013	Koordinatör / HAZIRLAYAN	ONAYLAYAN
------------------------------	--------------------------	-----------