



Ders Bilgi Formu

Ders Adı	Kodu	Yerel Kredi	AKTS	Ders (saat/hafta)	Uygulama (saat/hafta)	Laboratuvar (saat/hafta)
Portföy Optimizasyonu	IST5122	3	7.5	3	0	0

Önkoşullar	Yok
------------	-----

Yarıyıl	Güz, Bahar
---------	------------

Dersin Dili	İngilizce, Türkçe
-------------	-------------------

Dersin Seviyesi	Yüksek Lisans Seviyesi
-----------------	------------------------

Ders Kategorisi	Uzmanlık/Alan Dersleri
-----------------	------------------------

Dersin Veriliş Şekli	Yüz yüze
----------------------	----------

Dersi Sunan Akademik Birim	İstatistik Bölümü
----------------------------	-------------------

Dersin Koordinatörü	Gülde Kemalbay
---------------------	----------------

Dersi Veren(ler)	Gülde Kemalbay
------------------	----------------

Asistan(lar)ı	
---------------	--

Dersin Amacı	Bu dersin amacı klasik ortalama-varyans modeli yanı sıra çeşitli portföy optimizasyon modelleri ve çözümlerini öğretmektir.
--------------	---

Dersin İçeriği	Bu dersin içeriği: Kuadratik Optimizasyon, Markowitz Ortalama-Varyans Modeli, Etkin Sınır, Yüksek Momentler ile Portföy Optimizasyonu Modeli, Finansal Uygulamalar.
----------------	---

Opsiyonel Program Bileşenleri	Yok
-------------------------------	-----

Ders Öğrenim Çıktıları

1	Bu dersi başarı ile tamamlayan öğrenciler: Optimizasyon teorisinin finanstaki uygulamalarından portföy seçimi problemini tanır,
2	Riski minimize ve getiriye maksimize etmeyi öğrenir,
3	Modern portföy optimizasyon modellerini kavrar,
4	Yüksek mertebe momentler ile portföy seçer,
5	Portföy performans ölçülerini öğrenir.

Haftalık Konular ve İlgili Ön Hazırlık Çalışmaları

Hafta	Konular	Ön Hazırlık
1	Optimizasyon Teorisine Giriş	
2	Karesel Programlama	
3	Portföy Yönetimine Giriş	
4	Portföy Beklenen Getirisi ve Riski	
5	Riskin Alternatif Ölçütleri	
6	Markowitz Portföy Teorisi, Etkin Sınır	
7	Ortalama-Varyans Portföy Optimizasyonu	
8	Midterm 1	

9	Lineer Olmayan Programlama	
10	Yüksek Momentler ile Portföy Seçimi	
11	Yüksek Momentler ile Portföy Seçimi	
12	Portföy Performans Ölçüleri	
13	Finansal Uygulamalar	
14	Finansal Uygulamalar	
15	Final	

Değerlendirme Sistemi

Etkinlikler	Sayı	Katkı Payı
Devam/Katılım		
Laboratuvar		
Uygulama		
Arazi Çalışması		
Derse Özgü Staj		
Küçük Sınavlar/Stüdyo Kritiği		
Ödev	1	30
Sunum/Jüri		
Projeler		
Seminer/Workshop		
Ara Sınavlar	1	30
Final	1	40
Dönem İçi Çalışmaların Başarı Notuna Katkısı		60
Final Sınavının Başarı Notuna Katkısı		40
TOPLAM		100

AKTS İşyükü Tablosu

Etkinlikler	Sayı	Süresi (Saat)	Toplam İşyükü
Ders Saati	13	3	39
Laboratuvar			
Uygulama			
Arazi Çalışması			
Sınıf Dışı Ders Çalışması	13	8	104
Derse Özgü Staj			
Ödev	1	24	24
Küçük Sınavlar/Stüdyo Kritiği			
Projeler			
Sunum / Seminer			
Ara Sınavlar (Sınav Süresi + Sınav Hazırlık Süresi)	1	24	24
Final (Sınav Süresi + Sınav Hazırlık Süresi)	1	36	36

Toplam İşyükü	227
Toplam İşyükü / 30(s)	7.57
AKTS Kredisi	7.5

Diğer Notlar	Yok
--------------	-----