



MARMARA UNIVERSITÄT - Fakultät für Betriebswirtschaftslehre

Betriebswirtschaftslehre (in Deutscher Sprache)

SYLLABUS

| Vorlesungscode | Name der Vorlesung | Vorlesungstyp | Vorlesungsgruppe * für Wahlfächer | Semesterwoche nstunden (SWS) | | ECTS | Voraussetzungsveranstaltung mindestnote in Buchstaben-format |
|---|-------------------------|--|--------------------------------------|---------------------------------|---|-------------------|---|
| | | | | T | P | | |
| FNCE3004 | Portefeuille Management | Schwerpunkt Pflichtfach | | 3 | 0 | 5 | |
| Voraussetzung | | Mindestnote in Buchstaben-format | | | | Note | |
| Veranstaltungssprache | | | | | | | |
| Vortragende/-r | | | | | | | |
| Lehrinhalt | | Erlernen der Arten und Preise von Wertpapieren, Untersuchung der Preisbildung von Wertpapieren an Finanzmärkten, Portfoliotheorie und -ansätze, Bewertung und Analyse von Finanzinstrumenten. | | | | | |
| Lernziele der Vorlesung | | Das Ziel dieses Kurses umfasst eine detaillierte Untersuchung und Analyse im Rahmen effektiver Portfoliomanagementtechniken und Modelle zur Messung der Portfolioperformance. | | | | | |
| Empfohlene oder Pflichtliteratur | 1. | 1/ Mehmet Bana Karan, Tattilim Analizi ve Portfolyo Yönetimi, Gazi Kitabevi, 7. Baskı, 2021 2/ Enzo Wondolillo, Portfoliomanagement, Springer Gabler, 2. Auflage, 2015 3/ Klaus Sreemann, Portfoliomanagement, Oldenbourg, 4. Auflage, 2008 4/ Rellu&Brown, Investment | | | | | |
| | | | | | | | |
| | | | | | | | |
| | | | | | | | |
| | | | | | | | |
| Lernergebnisse | 1. | Berechnen Sie Renditen und Risiken aus Wertpapieren | | | | | |
| | 2. | Berechnen Sie die Gesamtrendite und das Risiko innerhalb des Portfolios | | | | | |
| | 3. | Erstellen Portfoliokombinationen nach riskanter-risikofreier Vermögenstrennung und Risikobereitschaft der Anleger | | | | | |
| | 4. | Beherrschen Sie Portfoliomanagement-Strategien | | | | | |
| | 5. | Sie können In der Lage sein, Portfolioleistungen zu messen und zu bewerten. | | | | | |
| Geplante Lernaktivitäten und Lehrmethoden | | | | | | | |
| WOCHE | Datum | Veranstaltungsinhalt | | | | | |
| Woche 1 | | Portfoliokonzept, Portfoliomanagement, Portfoliomanagementprozess, Definition von Risiken und Quellen | | | | | |
| Woche 2 | | Traditionelle Portfoliotheorie, Markowitz Moderne Portfoliotheorie - Grundprinzipien und Unterschiede | | | | | |
| Woche 3 | | Messung der erwarteten Rendite und der Standard Abweichung eines Wertpapiers | | | | | |
| Woche 4 | | Effektive Grenze, Indifferenzkurven, optimale Portfolioerstellung, optimale Portfoliokombinationen nach Risikobereitschaft | | | | | |
| Woche 5 | | Messung von Portfoliorendite und -risiko, Konzept der risikofreien Anlage, Rendite- und Risikoberechnung in einem Portfolio I | | | | | |
| Woche 6 | | Messung von Portfoliorendite und -risiko, Konzept der risikofreien Anlage, Rendite- und Risikoberechnung in einem Portfolio II | | | | | |
| Woche 7 | | Financial Asset Pricing Model (CAPM) - Theorie und Berechnungen I | | | | | |
| Woche 8 | | Zwischenprüfung/-en | | | | | |
| Woche 9 | | Financial Asset Pricing Model (CAPM) - Theorie und Berechnungen I | | | | | |
| Woche 10 | | Arbitrage-Preismodell | | | | | |
| Woche 11 | | Fama-French Drei-Faktoren-Modell | | | | | |
| Woche 12 | | Portfoliomanagement-Strategien - Aktiva und Passiva-Portfoliomanagement-Strategie | | | | | |
| Woche 13 | | Portfolioleistung – Sharpe, Treynor, Alfa | | | | | |
| Woche 14 | | Fallstudie - Unternehmensanwendung | | | | | |
| Woche 15 | | Fallstudie - Unternehmensanwendung | | | | | |
| Woche 16 | | Studienwoche | | | | | |
| Woche 17 | | Finalprüfung | | | | | |
| Aktivitäten und Kriterien | | Aktivitäten | Anzahl | Dauer | | Gewichtung im (%) | Gewichtung in der Semester Bewertung (%) |
| | | Finalprüfung | 1 | | | 50 | 0 |
| | | Wiederholungsprüfung | 1 | | | 50 | 0 |
| | | Semester Bewertung | | | | 50 | 100 |
| | | Zwischenprüfung/-en | 1 | | | 50 | 100.0 |
| | | Quiz | | | | | |
| | | Projekt/-e | | | | | |

| | | | | | | | |
|---|----------------|-----------------------------|--|----------------------------|--------|-----------------------------|--|
| | | Aufgabe/-n | | | | | |
| | | Labor | | | | | |
| | | Sonstige | | | | | |
| | | | | | | | |
| *** ECTS Leistungspunkte und Arbeitsaufwand *** | | | | | | | |
| Bewertungsinstrument | Stunden/Anzahl | Studentische Arbeitsaufwand | | Bewertungsinstrument | Anzahl | Studentische Arbeitsaufwand | |
| Theorie | 3.0 | 42.0 | | Quiz & Vorbereitung | | | |
| Praxis | 0.0 | 0.0 | | Hausaufgaben | 10 | 10.0 | |
| Labor | | | | Projekt | | | |
| Selbststudium vor der Veranstaltung | 1.0 | 14.0 | | Forschung und Präsentation | | | |
| Selbststudium nach der Veranstaltung | 2.0 | 28.0 | | Seminar | | | |
| Selbststudium nach der Bewertung | | | | Feldstudie | | | |
| Borbereitung für die Klausur & Zwischenprüfung | 10 | 10.0 | | Werkstatt | | | |
| Vorbereitung für die Klausur & Finalprüfung | 20 | 20.0 | | Sonstige | | | |
| SUMME : | | | | | 46.0 | 124.0 | |
| Empfohlene ECTS -Punkte (Gesamtstunden / 25) : | | | | | | 5 | |