

Ad-Soyad:

Numara:

Süre: 90 dk

T. C. Uşak Üniversitesi

9 Haziran 2026

Uygulamalı Bilimler Fakültesi Finans ve Bankacılık

2025-26 Bahar Yarıyılı Yatırım Analizi ve Portföy Yönetimi Dersi Final Sınavı

100.000	Finansal Varlık 1	Finansal Varlık 2	Finansal Varlık 3	Finansal Varlık 4	Finansal Varlık 5	Finansal Varlık 6	Finansal Varlık 7	Finansal Varlık 8
Varlık Adı	ABC	DEF	GHI	JKL	MNO	PQR	STU	WYZ
Portföy Ağırlığı (%)	20	25		10	35			10
Tutar (TL)	20.000	25.000		10.000	35.000			10.000
Miktar (Adet)	400,00	250,00		33,33	140,00			500,00
Günlük Ortalama Getiri	1,98	2,11	1,81	2,19	2,32	1,91	1,98	1,95
Standard Sapma	2,321	2,155	2,276	2,463	2,420	2,535	2,422	2,131
Risksiz Faiz oranı (Günlük)	1,50	1,50	1,50	1,50	1,50	1,50	1,50	1,50
Değişim Katsayısı	1,174	1,021	1,258	1,126	1,043	1,326	1,224	1,094
Sharpe Rasyosu	0,206	0,283	0,136	0,279	0,339	0,163	0,198	0,210
Alış Fiyatı 23-30 Nisan 2026	50,00	100,00	160,00	300,00	250,00	180,00	150,00	20,00
Satış Fiyatı 8 Haziran 2026	75,00	90,00		275,00	255,00			17,50
N. Getiri Oranı								
Portföyün Getiri Oranı								
Varlık Adı	ABC	DEF	GHI	JKL	MNO	PQR	STU	WYZ
Günlük Getiri 1	5,37	2,09	0,09	1,53	-0,43	1,12	3,78	-0,27
2	-0,70	5,36	2,85	-1,80	5,48	5,53	1,06	2,92
3	1,68	4,57	2,86	5,53	0,32	1,92	-0,65	0,70