

PORTFÖY YÖNETİMİ

1	Ders Adı:	PORTFÖY YÖNETİMİ
2	Ders Kodu:	IFY5311
3	Ders Türü:	Seçmeli
4	Ders Seviyesi	Yüksek Lisans
5	Dersin Verildiği Yıl:	1
6	Dersin Verildiği Yarıyıl	1
7	Dersin AKTS Kredisi:	6.00
8	Teorik Ders Saati (saat/Hafta)	3.00
9	Uygulama Ders Saati(saat/Hafta)	0.00
10	Laboratuvar Ders Saati (saat/hafta) :	0
11	Dersin Önkoşulu:	Yok
12	Dersin Dili:	Türkçe
13	Dersin Veriliş Şekli:	Yüz yüze
14	Dersin Koordinatörü:	Prof. Dr. Ümit Gücenme Gençoğlu
15	Dersi Veren Diğer Öğretim Elemanları:	Doç. Dr. Adem ANBAR
16	Koordinatör İletişim Bilgileri:	umitgucenme@uludag.edu.tr 0224 294 10 47
17	Dersin WEB adresi:	
18	Dersin Amacı:	Modern portföy yönetimi ve uygulamaları hakkında öğrencileri bilgi sahibi kılarak, bu konularda öğrencilerin yorum ve analiz yeteneğinin geliştirilmesi.
19	Dersin Mesleki Gelişime Katkısı:	
20	Dersin Öğrenme Kazanımları:	
	1	Portföy oluşturabilme, portföy yönetebilme ve portföy performansını değerlendirebilme.
	2	Portföy riskini ve portföyün getirisini hesaplayabilme.
	3	Etkin portföy ve optimal portföyün nasıl oluşturulacağını analiz edebilme.
	4	Finansal Varlık Fiyatlama Modeli ve Arbitraj Teorisi'ni açıklayabilme.
	5	Portföy yönetim şirketlerinde, aracı kurumlarda ve bankalarda çalışabilme yeterliliğine ve yeteneğine sahip olma.
	6	
	7	
	8	
	9	
	10	
21	Dersin İçeriği:	
Hafta	DERS İÇERİKLERİ	
	Teorik	Uygulama
1	Portföy, Portföy Yönetimi ve Portföy Yönetim Süreci	

2	Yatırımcı Türleri ve Portföy Çeşitleri	
3	Portföye Alınabilecek Yatırım Araçları	
4	Risk ve Risk Kaynakları	
5	Risk ve Beklenen Getirinin Hesaplanması	
6	Portföy Risk ve Getirisinin Hesaplanması	
7	Geleneksel Portföy Yaklaşımı	
8	Markowitz Portföy Kuramı	
9	İndeks Portföy Modelleri	
10	Sermaye Varlıklarını Fiyatlama Modeli	
11	Arbitraj Fiyatlama Kuramı	
12	Portföy Performansının Ölçülmesi	
13	Portföy Yönetim Stratejileri	
14	Uluslararası Portföy Yönetimi	

22	Ders Kitabı, Referanslar ve/veya Diğer Kaynaklar:	1. Borsada Uygulamalı Portföy Yönetimi, Ali CEYLAN - Turhan KORKMAZ 2. Yatırım ve Portföy Analizi, Özer ERTUNA 3. Yatırım Analizi ve Portföy Yönetimi, Mehmet Baha KARAN 4. Menkul Değer Yatırımlarının Yönetimi, Ünal BOZKURT 5. Portfolio Management, Theory and Applications, James FARRELL 6. Investment Analysis and Management, Clark FRANCIS
----	---	--

23	Değerlendirme	
----	---------------	--

YARIYIL İÇİ ÇALIŞMALARI	SAYISI	KATKI YÜZDESİ
Ara Sınav	0	0.00
Kısa Sınav	0	0.00
Ödev	2	30.00
Yıl Sonu Sınavı	1	70.00
Toplam	3	100.00
Yıl içi çalışmalarının Başarıya Oranı		30.00
Finalin Başarıya Oranı		70.00
Toplam		100.00
Kullanılan Ölçme ve Değerlendirme Yaklaşımları		

24	AKTS / İŞ YÜKÜ TABLOSU	
----	------------------------	--

ETKİNLİK	SAYISI	Süresi (Saat)	Toplam İş Yüğü (Saat)
Teorik Dersler	14	3.00	42.00
Uygulamalı Dersler	0	0.00	0.00
Sınıf Dışı Ders Çalışma Süresi (Ön çalışma, pekiştirme)	14	3.00	42.00
Ödevler	2	30.00	60.00
Projeler	0	0.00	0.00
Arazi Çalışmaları	0	0.00	0.00
Arasınaylar	0	0.00	0.00
Diğer	0	0.00	0.00
Yarıyıl Sonu Sınavı	1	36.00	36.00
Toplam İş Yüğü			180.00
Toplam İş Yüğü / 30 saat			6.00
Dersin AKTS Kredisi			6.00

25	PROGRAM YETERLİLİKLERİ İLE DERS ÖĞRETİM KAZANIMLARI İLİŞKİSİ TABLOSU															
	PY1	PY2	PY3	PY4	PY5	PY6	PY7	PY8	PY9	PY10	PY11	PY12	PY13	PY14	PY15	PY16
ÖK1	0	0	4	3	0	0	5	0	5	0	5	0	0	0	0	0
ÖK2	0	0	4	3	0	0	0	0	5	0	0	0	0	0	0	0
ÖK3	0	0	4	3	0	0	0	0	5	0	5	0	0	0	0	0
ÖK4	0	0	4	3	0	0	0	0	5	0	0	0	0	0	0	0
ÖK5	0	3	4	3	0	0	0	0	0	0	5	0	0	0	0	0
ÖK: Öğrenme kazanımlar PY: Program yeterlilikleri																
Katkı Düzeyi:	1 çok düşük		2 Düşük		3 Orta		4 Yüksek		5 Çok Yüksek							