

DERS BİLGİLERİ					
Ders Adı	Kod	Yarıyıl	L+P (Saat)	Kredi	AKTS
Portföy Yönetimi	UTF-311	5	3+0	3	5
<b>Ön Şartlar</b>	Yok				
<b>Eğitim Dili</b>	İngilizce				
<b>Dersin Seviyesi</b>	Lisans				
<b>Dersin Tipi</b>	Zorunlu				
<b>Dersi Veren Öğretim Üyesi</b>	Dr.Öğr.Üyesi Bahadır ERGÜN				
<b>Asistanlar</b>					
<b>Hedefler</b>	Ders, güvenlik seçimi, portföy yönetimi ve yatırım değerlendirilmesini teorik yöntemlerle öğretmeyi amaçlamaktadır. Çeşitli problem çözme oturumları ile yatırım ve portföy yönetimi becerilerini geliştirmek.				
<b>Dersin İçeriği</b>	Ders, Uluslararası Ticaret ve Finansman öğrencilerine yönelik seçmeli bir finans dersi ve portföy yönetimine odaklanır. Dahil olan çalışma konuları, finansal sistem, para piyasası araçları, sermaye piyasası araçları, vadeli işlemler piyasası, finansal türevler, finansal kurumlar, finansal varlık değerlemesi ve portföy analizi gibi unsurlar ve mekanizmalardır.				
<b>Öğrenme Çıktıları</b>	1. Finansal varlıklarda risk-getiri kavramlarını açıklar, 2. Bireysel finansal varlık ve portföyün risk ve iadesini hesaplar, 3. Finansal varlıkların verimli bir şekilde nasıl çeşitlendirileceğini açıklar, 4. Verimli bir portföy oluşturmak için menkul kıymetlerin nasıl seçileceğini açıklar, 5 En uygun portföyün nasıl oluşturulacağını açıklar. 6. Sermaye Varlık Fiyatlandırma Modelini ve Arbitraj Fiyatlandırma Model'ini açıklar, 7.Güvenlik yönetiminin kuramsal temellerini kavrar, 8. Varlık tahsis hakkında bilgi sahibi olur, 9. Tahvil ve hisse senedi değerlemesi hakkında bilgi sahibi olur.				

DERSİN İÇERİĞİ		
Hafta	Teorik	Uygulama
1	Giriş	
2	Finansal sistemin unsurları ve mekanizması	
3	Para piyasası araçları	
4	Sermaye piyasası araçları (hisse senedi)	
5	Sermaye piyasası araçları (tahvil)	
6	Sermaye piyasası araçları (diğerleri)	
7	Vadeli işlemler piyasası	
8	Ara Sınav	
9	Finansal türevler (Vadeli, Vadeli İşlemler, Opsiyonlar)	
10	Finansal kurumlar (Merkez Bankası ve ticari bankalar)	
11	Finansal kurumlar (yatırım bankaları, yatırım ortaklıkları vb.)	
12	Finansal kurumlar (Borsa İstanbul, SPK, BDDK, İAB)	
13	Finansal varlık değerlemesi	
14	Portföy analizi	
15	Final Sınavı	
16	Final Sınavı	

ÖNERİLEN KAYNAKLAR	
Reilly & Brown, Investment Analysis & Portfolio Management, 8th Edition, Thomson One, 2005.	

Ders İş Yüğü		
Etkinlik	Sayı	Katkısı (%)
Ara Sınav	1	40
Final Sınavı	1	60
Quiz	0	0
Ödev	0	0
<b>Toplam</b>		<b>100</b>



\_\_\_\_\_

