



AYDIN ADNAN MENDERES ÜNİVERSİTESİ
SÖKE MESLEK YÜKSEKOKULU
FİNANS, BANKACILIK VE SİGORTACILIK BÖLÜMÜ
BANKACILIK VE SİGORTACILIK PROGRAMI
DERS BİLGİ FORMU

Dersin Adı	Portföy Yönetimi								
Ders Kodu	BSS208			Ders Düzeyi		Önlisans			
AKTS Kredi	3	İş Yüğü	79 (Saat)	Teori	3	Uygulama	0	Laboratuvar	0
Dersin Amacı	Bu ders ile öğrencinin portföy yönetimi konusunda bilgi sahibi olması amaçlanmaktadır.								
Özet İçeriğı	Bu dersin amacı, yatırım analizinde sıklıkla kullanılan kantitatif araç ve modellere bir bakış açısı kazandırılmasını sağlamaktır. Aynı zamanda para ve sermaye piyasalarını, sabit getirili menkul kıymetleri, türev ürünleri ve portföy yönetimi gibi konuları içermektedir. Temel konular, bireysel menkul kıymetlerin analizi ve menkul kıymet portföylerinin analizi konularıdır.								
Staj Durum	Yok								
Öğretim Yöntemleri	Anlatım (Takrir), Örnek Olay, Problem Çözme								
Dersi Veren Öğretim Elemanı(ları)									

Ölçme ve Değerlendirme Araçları

Araç	Adet	Oran (%)
Ara Sınav (Vize)	1	40
Dönem Sonu Sınavı (Final)	1	60

Ders Kitabı / Önerilen Kaynaklar

1	Sermaye Piyasası Analizleri Ve Portföy Yönetimi , Mehmet Civan, Gazi Kitabevi
2	Yatırım Analizi ve Portföy Yönetimi, M. Baha Karan, Gazi Kitabevi
3	3. Ertuna, İ.Ö. (1991) Yatırım ve Portföy Analizi Bilgisayar Uygulama Örnekleriyle Boğaziçi Üniversitesi Yayınevi

Hafta	Haftalara Göre Ders Konuları	
1	Teorik	Genel kavramlar; portföy tanımı, geleneksel portföy teorisi
2	Teorik	Geleneksel ve modern portföy teorisi
3	Teorik	Tek tek finansal varlıkların getirilerinin ve risklerinin hesaplanması
4	Teorik	Portföy getirisinin ve riskinin ölçümü
5	Teorik	İki varlıktan bir portföy oluşturulması
6	Teorik	Sermaye varlıklarını fiyatlama modeline (SVFM) giriş
7	Teorik	SVFM ile varlıkların fiyatlandırılması
8	Teorik	Arbitraj fiyatlama modeli
9	Teorik	Aktif portföy yönetimi
10	Teorik	Portföy performansının değerlendirilmesi
11	Teorik	Financial Analysis (Cash Budget)
12	Teorik	Portföy performansının değerlendirilmesi
13	Teorik	İşlenen konuların gözden geçirilmesi
14	Teorik	İşlenen konuların gözden geçirilmesi

Dersin Öğrenme, Öğretme ve Değerlendirme Etkinlikleri Çerçevesinde İş Yüğü Hesabı (Ortalama Saat)

Etkinlik	Adet	Ön Hazırlık	Etkinlik Süresi	Toplam İş Yüğü
Kuramsal Ders	14	1	2	42
Ödev	5	3	0	15
Ara Sınav	1	10	1	11
Dönem Sonu Sınavı	1	10	1	11
Toplam İş Yüğü (Saat)				79
Yuvarla [Toplam İş Yüğü (saat) / 25*] = AKTS Kredisi				3

*25 saatlik iş yüğü 1 AKTS olarak kabul edilmektedir.



Dersin Öğrenme Çıktıları

1	Portföy yöneticiliği konusunda bilgilendirmek
2	Menkul kıymet piyasalarında halka arzın nasıl yapıldığını, hisse senetlerinin nasıl işlem gördüğünü ve açığa satışın nasıl yapıldığını değerlendirebilecektir
3	Finansal varlıklarda getiri ve risk kavramları hakkında bilgi verebilecektir
4	Etkin portföy ve optimal portföyün nasıl oluşturulacağını analiz edebilecektir
5	Finansal Varlık Fiyatlama Modeli ve Arbitraj Fiyatlama Teorisinin açıklayabilecektir

Program Çıktıları (Bankacılık ve Sigortacılık Programı)

1	Mesleklerinin gerektirdiği temel ekonomi bilgisine sahiptir.
2	İş hayatında ara eleman seviyesine yetecek düzeyde temel hukuk bankacılık hukuku bilgisine sahiptir.
3	İşlerinin gerektirdiği muhasebe sistem ve organizasyonu hakkında bilgi sahibidir.
4	Temel finans ve bankacılık bilgilerini bilir.
5	İşlerinin gerektirdiği ölçüde günlük mali nitelikli olayların kaydedilmesini bilir.
6	İşlerinin gerektirdiği mali analiz tekniklerini bilir.
7	İş güvenliği, işçi sağlığı, çevre koruma bilgisi ve kalite bilincine sahip olmak.
8	İşlerinin gerektirdiği seviyede işletme yönetimi bilgisine sahiptir.
9	Bankaların örgütsel yapıları hakkında bilgi sahibidir.
10	Bankalarda iç dış ve kamu denetimleri hakkında temel bilgilere sahiptir.
11	İnsan kaynakları hakkında işlerinin gerektirdiği ölçüde bilgiye sahiptir.

Program ve Öğrenme Çıktıları İlişkisi 1:Çok Düşük, 2:Düşük, 3:Orta, 4:Yüksek, 5:Çok Yüksek

	ÖÇ1	ÖÇ2	ÖÇ3	ÖÇ4	ÖÇ5
PÇ1	3		2		
PÇ2	3		2	2	2
PÇ4	2	2	2	2	2
PÇ5	3	3	2	2	4
PÇ6	3	3	2		
PÇ9	2				

