



AYDIN ADNAN MENDERES ÜNİVERSİTESİ DERS BİLGİ FORMU

Dersin Adı		Portföy Yönetimi							
Ders Kodu		UEK516		Ders Düzeyi		Yüksek Lisans			
AKTS Kredi	5	İş Yüğü	126 (Saat)	Teori	3	Uygulama	0	Laboratuvar	0
Dersin Amacı									
Özet İçeriği									
Staj Durum		Yok							
Öğretim Yöntemleri		Anlatım (Takrir)							
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	Mustafa Sevuğtekin, Ekonometriye Giriş, Dora Yayınları, Bursa, 2013.
---	--

Hafta	Haftalara Göre Ders Konuları	
1	Teorik	Giriş
2	Teorik	Yatırım ortamı: a) Reel varlık / finansal varlık nedir b) Finansal piyasalar ve ekonomi c) Piyasa oyuncularını d) Son Gelişmeler
3	Teorik	Varlık çeşitleri ve finansal enstrümanlar: a) Para piyasası b) Tahvil piyasası c) Menkul kıymet piyasası d) Menkul kıymet ve tahvil endeksleri e) Türev piyasalar
4	Teorik	Menkul kıymet piyasaları: a) Halka Arz b) Amerika Borsaları c) Emir çeşitleri d) Açığa satış
5	Teorik	Yatırım Fonları ve Diğer Yatırım Şirketleri: a) Yatırım Şirketleri b) Yatırım Fonları c) Yatırım Fonlarına Yatırım Yapmanın Maliyeti d) Borsa Yatırım Fonları
6	Teorik	Risk ve Getiri: a) Finansal Varlıklarda Risk ve Getiri Kavramları b) Risk ve Getiri Analizi c) Risk primi d) Normal Dağılım e) Uzun Vadeli Yatırımlar
7	Teorik	Riske Maruz Değer Hesaplaması
9	Teorik	Ara sınav
10	Teorik	Riskten kaçınma ve riskli varlıklara yatırım: a) Risk ve riskten kaçınma b) Risksiz Varlık c) Pasif Stratejiler: Sermaye Piyasası Doğrusu
11	Teorik	Endeks Modelleri: a) Tek endeks modeli b) Portföy oluşturma ve tek endeks modeli
12	Teorik	Sermaye Varlıklarını Fiyatlandırma Modeli
13	Teorik	Arbitraj Fiyatlandırma Teorisi
14	Teorik	İşlenen konular doğrultusunda örnek soru çözümü yapılması
15	Teorik	Dönemin gözden geçirilmesi

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

Etkinlik	Adet	Ön Hazırlık	Etkinlik Süresi	Toplam İş Yüğü
Kuramsal Ders	14	6	3	126
Toplam İş Yüğü (Saat)				126
Yuvarla [Toplam İş Yüğü (saat) / 25*] = AKTS Kredisi				5

*25 saatlik iş yüğü 1 AKTS olarak kabul edilmektedir.

Dersin Öğrenme Çıktıları

1	Finans ekonomisi alanında edindiğı uzmanlık düzeyindeki kuramsal ve uygulamalı bilgileri kullanabilmek.
2	Finans ekonomisi alanındaki herhangi bir olay ya da sorunu tek başına kavrayabilmek ve değerlendirebilmek, problemlere bağımsız olarak çözüm üretebilmek ve gerektiğinde bu çözüm yollarını uygulayabilmek.
3	Finans ekonomisi alanlarında karşılaşacağı olağandışı ve karmaşık durumlarda yeni stratejik yaklaşımlar geliştirebilmek ve sorumluluk alarak çözüm üretebilmek.
4	Yaşadığı bölgenin ekonomik ve sosyal ihtiyaçlarını gündeme getirebileceğı iletişim ağlarına hakim olmak.



5	Finans ekonomisi ile ilgili verilerin toplanması, yorumlanması ve duyurulması aşamasında toplumsal, bilimsel ve etik değerleri gözeterek bu değerleri öğretebilmek ve denetleyebilmek.
---	--

Program Çıktıları (Uygulamalı Ekonometri Disiplinlerarası Yüksek Lisans Programı)

1	Ekonomik ve toplumsal konular üzerine veri toplayabilecektir.
2	Ham veriyi istatistiksel ve ekonometrik analizlere uygun hale getirebilecektir.
3	Veriyi oluşturan mekanizmaları açıklayan ekonometrik modeller kurabilecektir.
4	Ekonometrik analizler aracılığıyla elde edilmiş olan sonuçları yorumlayabilecektir.
5	Bağımsız bir ampirik araştırmayı başlangıcından sonuna dek yürütebilecektir.

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

	ÖÇ1	ÖÇ2	ÖÇ3	ÖÇ4	ÖÇ5
PÇ1	1	4	2	3	1
PÇ2	2	5	3	4	1
PÇ3	4	2	5	4	2
PÇ4	2	4	4	5	3
PÇ5	3	3	3	2	4

