

DERS TANITIM ve UYGULAMA BİLGİLERİ

Dersin Adı	Kodu	Yarıyıl	T+U+L (saat/hafta)	Türü (Z / S)	Yerel Kredi	AKTS
Portföy Yönetimi	FN 412	Bahar	03+00+00	Zorunlu	3	4
Akademik Birim:	İşletme Fakültesi					
Öğrenim Türü:	Örgün eğitim					
Ön Koşullar	Yok					
Öğrenim Dili:	Türkçe					
Dersin Düzeyi:	Seviye Belirtilmemiş					
Dersin Koordinatörü:	Mustafa Çanakcıoğlu					
Dersin Amacı:	Finansal piyasaların ve sermaye piyasası araçlarının tanıtılarak, portföy yönetimine ilişkin temel kavramların ve teorilerin öğretilmesidir.					
Dersin İçeriği:	Menkul kıymetlerin çeşitlerinin ve fiyatlandırılmasına ilişkin teorilerin öğrenilmesi, finansal piyasalarda menkul kıymetlerin fiyat oluşumunun incelenmesi, portföy teori ve yaklaşımları ile finansal araçların değerlendirilmesi ve analizinin yapılması.					
Dersin Öğrenme Çıktıları (ÖÇ):	1- Finansal piyasalar ve finansal kurumlara ilişkin temel kavramları öğrenir 2- Finansal piyasaların işleyişi kavrar 3- Finansal piyasalarda işlem gören menkul kıymetler ve değerlendirilmesi hakkında bilgi sahibi olur 4- Portföy teorisi ve risk azaltımı stratejilerini öğrenir					
Dersin Öğrenme Yöntem ve Teknikleri	Ders, çalışma soruları, ödevler, okuma					

HAFTALIK PROGRAM

Hafta	Konular	Ön Hazırlık
1	Finansal Piyasalar ve Finansal Kurumlar	
2	Finansal Piyasaların Türleri	
3	Sermaye Piyasası Araçları	
4	Menkul Kıymetler ve Değerlemesi	
5	Portföy Yönetimine Giriş	
6	Risk ve Getiri Hesaplamaları	
7	Ara Sınav	
8	Geleneksel Portföy Yönetimi	
9	Modern Portföy Yönetimine Giriş	
10	Finansal Varlıkları Fiyatlama Modeli (CAPM)	
11	Arbitraj Fiyatlama Teorisi	
12	Fama-French'in Üç Faktör Modeli	
13	Portföy Performansının Ölçülmesi	
14	Türev Ürünler	

Kadir Has Üniversitesi'nde bir dönem 14 haftadır, 15. ve 16. hafta sınav haftalarıdır.

ZORUNLU ve ÖNERİLEN OKUMALAR

- 1) Prof. Dr. Erdinç Altay, Sermaye Piyasası'nda Varlık Fiyatlama Teorileri, Derin Yayınları, 2inci Baskı, 2012.
- 2) Prof. Dr. Mehmet Baha Karan, Yatırım Analizi ve Portföy Yönetimi, Gazi Kitabevi 4. Baskı 2013

DİĞER KAYNAKLAR

DEĞERLENDİRME SİSTEMİ

Yarıyıl İçi Çalışmaları	Sayı	Katkı Payı (%)
Ödev	7	-
Ara Sınavlar/Sözlü Sınavlar/Kısa Sınavlar	1	40
Final Sınavı	1	60
Total:	9	100

İŞ YÜKÜ HESAPLAMASI

Etkinlikler	Sayısı	Süresi (saat)	Toplam İş Yüğü (saat)
Ders Saati	14	3	42
Ödev	7	3	21
Ara Sınavlar/Sözlü Sınavlar/Kısa Sınavlar	1	15	15
Final Sınavı	1	25	25
Toplam İş Yüğü (saat):			103

1 AKTS = 25 saatlik iş yükü

PROGRAM YETERLİLİKLERİ (PY) ve ÖĞRENME ÇIKTILARI (ÖÇ) İLİŞKİSİ

#	PY1	PY2	PY3	PY4	PY5	PY6	PY7	PY8	PY9	PY10	PY11	PY12	PY13
OC1	3	1		2	1	1	3		3		3		
OC2	3	3		2	3	2	3		3		3		
OC3	3	3		3	3	3	3		3		3		
OC4	3	3		3	3	3	3		3		3		

Katkı Düzeyi: 1 Düşük, 2 Orta, 3 Yüksek

