



Bandırma Onyedi Eylül Üniversitesi

Ömer Seyfettin Uygulamalı Bilimler Fakültesi
Uluslararası Ticaret ve Lojistik

UTL4210 Portföy Yönetimi					
Yarıyıl	Kodu	Adı	T+U	Kredi	AKTS
8	UTL4210	Portföy Yönetimi	3	3	4
Öğretim Türü	Dersin Dili	Dersin Düzeyi	Dersin Staj Durumu	Dersin Türü	
Örgün Öğretim	Türkçe	Fakülte	Yok	Seğmeli	
Bölümü/Programı	Ön Koşul	Dersin Koordinatörü	Dersi Veren	Dersin Yardımcıları	
Uluslararası Ticaret ve Lojistik		Doç.Dr. Çağatay BAŞARIR	Doç.Dr. Mustafa YURTTADUR	Yok	

Dersin Amacı :

Bu dersin amacı, finansal varlık türleri ve finansal kurumlara değinerek, finansal varlıklara yatırım süreci ve bu yatırım sürecinin işleyiş mekanizması hakkında bilgi vermektir.

Öğretim Yöntem ve Teknikleri :

Dersin içeriğini yatırım ortamı ve piyasa oyuncuları, menkul kıymet borsaları, portföy risk ve getirisi, etkin portföy seçimi, sermaye varlıklarını fiyatlama modeli, arbitraj fiyatlama teorisi oluşturmaktadır.

Dersin Kaynakları

Kaynakları

Yatırım Analizi ve Portföy Yönetimi, Baha Karan
Borsada Uygulamalı Portföy Yönetimi, A. Ceylan ve T. Korkmaz
Sermaye Piyasası ve Portföy Analizi, Hüseyin Dağlı
Finansal Pazarlar, Serpil Canbaş, Hatice Doğanlı
Yüz yüze

Ders Yapısı

Matematik ve Temel Bilimler	:	Eğitim Bilimleri	:
Mühendislik Bilimleri	:	Fen Bilimleri	:
Mühendislik Tasarımı	:	Sağlık Bilimleri	:
Sosyal Bilimler	:	Alan Bilgisi	:
	: 100		

Ders Konuları

Hafta	Konu	Ön Hazırlık	Dökümanlar
1	Finansal Piyasalar, Hisse Senedi Piyasaları, Türev Piyasalar, SPK, İMKB, VOB		Anlatım, Soru-Cevap, Tartışma
2	Menkul kıymet kavramı, yatırım fonu, türev finansal araçlar.		Anlatım, Soru-Cevap, Tartışma
3	Portföy tanımı, geleneksel portföy teorisi ve modern portföy teorisi		Anlatım, Soru-Cevap, Tartışma
4	Etkin piyasalar kuramı, temel analiz, teknik analiz		Anlatım, Soru-Cevap, Tartışma
5	Markowitz portföy teorisine giriş		Anlatım, Soru-Cevap, Tartışma
6	Portföy getirisinin ve riskinin ölçümü		Anlatım, Soru-Cevap, Tartışma
7	İki varlıktan bir portföy oluşturulması ve etkin sınırın oluşturulması		Anlatım, Soru-Cevap, Tartışma
8	İki varlıktan bir portföy oluşturulması ve etkin sınırın oluşturulması		Anlatım, Soru-Cevap, Tartışma
9	Sermaye varlıklarını fiyatlama modeline (SVFM) giriş		Anlatım, Soru-Cevap, Tartışma
10	SVFM ile varlıkların fiyatlandırılması		Anlatım, Soru-Cevap, Tartışma
11	Arbitraj fiyatlama modeli		Anlatım, Soru-Cevap, Tartışma
12	Portföy performansının değerlendirilmesi		Anlatım, Soru-Cevap, Tartışma
13	Aktif – Pasif portföy yönetimi		Anlatım, Soru-Cevap, Tartışma
14	Aktif – Pasif portföy yönetimi		Anlatım, Soru-Cevap, Tartışma

Dersin Öğrenme Çıktıları

Sıra No	Açıklama
Ö01	Finansal piyasalar ve yatırım araçları hakkında bilgi sahibi olabilmek
Ö02	Portföy yatırımının nasıl yapıldığını yorumlayabilmek
Ö03	Finans varlık türleri ve finansal kurumlar hakkında bilgi sahibi olabilmek
Ö04	Portföy performansını hesaplayabilmek
Ö05	Portföy yönetimindeki riskler ve etkilerini açıklayabilmek

Programın Öğrenme Çıktıları

Sıra No	Açıklama
P06	Stratejik Düşünme: Öğrenciler, iş dünyasındaki değişen koşulları analiz edebilmek ve stratejik planlar oluşturabilmek becerisi kazanır.
P05	Sürdürülebilirlik ve Teknolojik Uygulamalar: Öğrenciler, lojistik ve ticaret operasyonlarını sürdürülebilir ve teknoloji odaklı bir şekilde yönetme yeteneği kazanır. Bu, sürdürülebilirlik ilkelerini anlama, yeşil lojistik uygulamalarını benimseme ve son teknolojileri kullanarak iş süreçlerini optimize etme yeteneğini içerir.
P07	Ulusal ve Uluslararası İletişim: Öğrenciler, farklı kültürler ve diller arasında etkili iletişim kurma yeteneği geliştirir. Bu, ulusal ve uluslararası iş dünyasında başarılı iletişim için kritik bir yeterliliktir.
P09	Veri Analizi: Öğrenciler, büyük veri ve analitik araçlarını kullanarak iş süreçlerini iyileştirme ve veriye dayalı kararlar alma yeteneğini geliştirir.
P08	Risk Yönetimi: Öğrenciler, ticaret ve lojistik operasyonlarında karşılaşılan riskleri tanımlama, analiz etme ve etkili bir şekilde yönetme yeteneği kazanır.
P10	İşbirliği ve Ekip Çalışması: Öğrenciler, çok kültürlü ekiplerde çalışma yeteneği kazanır ve işbirliği içinde karmaşık projeleri yönetme yeteneğini içerir.
P01	Küresel Sorumluluk: Öğrenciler, küresel ticaretin etik ve sürdürülebilir boyutlarına duyarlılık geliştirir ve bu sorumlulukla küresel ekonomik ve sosyal sorunları anlama yeteneği kazanır.
P04	Kültürel Farkındalık: Öğrenciler, kültürel çeşitliliği anlama ve küresel pazarlarda etkili iletişim ve işbirliği kurma yeteneği geliştirir.
P03	Etik Liderlik: Öğrenciler, iş dünyasında etik liderler olarak hareket etme yeteneği kazanır. Bu, toplumsal değerlere saygılı bir şekilde kararlar alabilmek ve iş etiği konularında hassaslık gösterme becerisi içerir.
P02	Yaratıcı Çözümleme: Öğrenciler, lojistik ve ticarette karşılaşılan karmaşık sorunları analiz etme ve yaratıcı, etkili çözümler üretme becerisi geliştirir.



<https://obs.bandirma.edu.tr/oibs//bologna/progCourseDetails.aspx?curCourse=750301&lang=tr&curProgID=5237>

Değerlendirme Ölçütleri			AKTS Hesaplama İçeriği			
Yarıyıl Çalışmaları	Sayısı	Katkı	Etkinlik	Sayısı	Süresi	Toplam İş Yüğü Saati
Ara Sınav	1	%40	Ders Süresi	14	3	42
Kısa Sınav	0	%0	Sınıf Dışı Ç. Süresi	14	3	42
Ödev	0	%0	Ödevler	1	6	6
Uygulama	0	%0	Sunum/Seminer Hazırlama	1	6	6
Proje	0	%0	Ara Sınavlar	1	14	14
Yarıyıl Sonu Sınavı	1	%60	Uygulama	0	0	0
Sözlü sınav	0	%0	Laboratuvar	0	0	0
Portfolyo	0	%0	Proje	0	0	0
Laboratuvar	0	%0	Yarıyıl Sonu Sınavı	1	14	14
Atölye	0	%0	Toplam İş Yüğü			124
Arazi Çalışması	0	%0	AKTS Kredisi			4
Seminer	0	%0				
Sunum	0	%0				
Bitirme çalışması	0	%0				

Dersin Öğrenme Çıktılarının Programın Öğrenme Çıktılarına Katkıları		

	P06	P08
Tüm	3	3
Ö01	3	2
Ö02	2	
Ö03	2	
Ö04	3	
Ö05	3	2



Değerlendirme Ölçütleri		
Yarıyıl Çalışmaları	Sayı	Katkı
Tez	0	%0
Toplam		%100

--

Dersin Öğrenme Çıktılarının Programın Öğrenme Çıktılarına Katkıları

www.bandirma.edu.tr

