



Türk Hava Kurumu Üniversitesi

Sosyal Bilimler Enstitüsü
İşletme (Tezli)

İFNS 506		Portföy Yönetimi			
Yarıyıl	Kodu	Adı	T+U	Kredi	AKTS
1	İFNS 506	Portföy Yönetimi	3	3	10

Dersin Dili:

Türkçe

Dersin Düzeyi:

Yüksek Lisans

Dersin Staj Durumu:

Yok

Bölümü/Programı:

İşletme (Tezli)

Dersin Türü:

Seçmeli

Dersin Amacı:

İşletme mezunu öğrencilerin büyük çoğunluğunun mezuniyet sonrasında muhasebeyle doğrudan ve/veya dolaylı bağlantılı bir mesleğe yönelindikleri gözlenmektedir. Dersin, Finans, Bankacılık veya Sermaye Piyasaları bağlantılı herhangi bir işin daha bilinçli seçilmesine katkı sağlayacağı düşünülmektedir. Bu doğrultuda, derste Finans, Bankacılık, Finansal Piyasalarda yer alan mesleklerle ilgili olarak öğrencilerin, portföy yönetiminin tüm temel konulara aşinalıklarını sağlanacak ve öğrencilerin tüm önemli yaklaşımları, hesaplamaları ve kuralları öğrenme ve bunları yorumlama bilgi ve becerisini kazanacaklardır

Öğretim Yöntem ve Teknikleri:

Bu derste sırasıyla portföy ve portföy yönetimi kavramları, finansal piyasalar, finansal piyasaların ayrıştırılması, para ve sermaye piyasası ve unsurları, sermaye piyasasının oyuncuları, menkul kıymet piyasasının işleyişi, türleri, etkinlik dereceleri, Türkiye'deki Sermaye piyasasının faaliyetleri, unsurları ve BİST, Faiz oranı, unsurları ve getiri eğrileri, portföy riski ve getirisi, Etkin sınır ve portföy seçimi, sermaye varlıklarını fiyatlandırma modeli (CAPM), faktör modelleri, Etkin piyasalar hipotezi ve pazarın etkinlik dereceleri, hisse senedi ve değerlendirme, tahvil ve değerlendirme gibi konular teorik ve uygulamalı olarak işlenecektir.

Ön Koşulları:

Dersin Koordinatörü:

Yok

Dersi Veren:

Doç.Dr. Yaşar KÖSE

Dersin Yardımcıları:

Yok

Dersin Kaynakları

Ders Notları : öğrencilere derste dağıtılacaktır.

Kaynakları : Yatırım

Dökümanlar : Yatırım Analizi ve portföy yönetimi, M.Baha KARAN

Ödevler : SUNUM GÖREVİ VERİLECEK

Sınavlar : ARA, KISA VE DÖNEM SONU SINAVLARI

Ders Yapısı

Matematik ve Temel Bilimler :

Mühendislik Bilimleri :

Mühendislik Tasarımı :

Sosyal Bilimler : 100

Eğitim Bilimleri :

Fen Bilimleri :

Sağlık Bilimleri :

Alan Bilgisi :

Ders Konuları

Hafta	Konu	Ön Hazırlık	Dökümanlar
1	portföy ve portföy yönetimi kavramları		
2	finansal piyasalar, doğrudan ve dolaylı finansman		
3	Türkiye'de finansal piyasalar ve araçları		
4	Menkul kıymetler borsası		
5	Faiz oranı, tanımı, yapısı		
6	Faiz oranı ve unsurları, faiz oranı yapısı		
7	Portföy riski ve getirisi		
8	Etkin sınır ve portföy seçimi		
9	CAPM		

Dersin Öğrenme Çıktıları

Sıra No	Açıklama
Ö01	dersin sonunda portföy, portföy yönetimi, finansal piyasalar kavramlarını öğrenerek ve sınıflandırılması yapabilecektir.
Ö02	Sermaye piyasaları, para piyasaları ve unsurlarını kavrayarak aralarındaki ilişkileri analiz edebilecek.
Ö03	dersin sonunda ETKİN SINIR, PORTFÖY SEÇİMİ VE CAPM'İ ÖĞRENECEKLER.
Ö04	HİSSE SENEDİ VE TAHVİL DEĞERLEMESİNİ YAPABİLECEK.

Programın Öğrenme Çıktıları

Sıra No	Açıklama
P01	İşletmenin temel fonksiyonlarını ve işletmeciliğin temel kavramlarını uzmanlık düzeyinde kavrayabilmek ve bunları pazarlama, üretim, muhasebe, finans, yönetim alanlarında uygulayabilmek.
P02	Etkin proje planlaması gerçekleştirilmeye yönelik olarak doğru proje yönetimi tekniklerini kullanabilmek.
P03	Yönetim- organizasyon alanına ilişkin edindiği bilgileri karar, uygulama ve davranışlarında kullanmak suretiyle verileri yorumlayabilmek, analiz edebilmek, sorunları tanımlayabilmek ve çözüm önerileri getirebilmek.
P04	Pazar araştırması, satış vb konularda verileri yorumlayabilmek, analiz edebilmek, pazarlama sorunlarını tanımlayıp çözüm önerileri getirebilmek
P05	İşletme yönetiminin ulusal ve küresel boyutlarındaki meydana gelen değişim ve gelişimi izleyebilmek ve analiz edip yorumlayabilmek.
P06	Finans alanının ilişkili olduğu temel işletmecilik fonksiyonlarıyla olan etkileşimini açıklayabilmek.
P07	Mali tabloları kullanarak işletmelerin finansal durumunu analiz edebilmek ve planlama yapabilmek.
P08	İş yaşamının hukuki, toplumsal ve sosyal ve etik yönlerini kavramak.
P09	İnsan Kaynakları Yönetimi ve diğer sosyal bilimler alanlarındaki kuramsal ve uygulamalı bilgileri beraber kullanabilme yeteneğini edinmek
P10	İşletme yönetiminin stratejik, taktik ve operasyonel boyutlarına hakim olmak, işletmeyi örgütsel düzeyde tasarlamak ve analiz edebilmek.

Değerlendirme Ölçütleri		
Yarıyıl Çalışmaları	Sayısı	Katkı
Ara Sınav	1	%30
Kısa Sınav	1	%10
Ödev	1	%10
Devam	0	%0
Uygulama	0	%0
Proje	0	%0
Yarıyıl Sonu Sınavı	1	%50
Toplam		%100

AKTS Hesaplama İçeriği			
Etkinlik	Sayısı	Süresi	Toplam İş Yükü Saati
Ders Süresi	15	3	45
Sınıf Dışı Ç. Süresi	15	3	45
Ödevler	5	5	25
Sunum/Seminer Hazırlama	5	4	20
Ara Sınavlar	1	2	2
Uygulama	0	0	0
Laboratuvar	0	0	0
Proje	0	0	0
Yarıyıl Sonu Sınavı	1	2	2
Toplam İş Yükü			139
AKTS Kredisi			5

Dersin Öğrenme Çıktılarının Programın Öğrenme Çıktılarına Katkıları										
Katkı Düzeyi: 1: Çok Düşük 2: Düşük 3: Orta 4: Yüksek 5: Çok yüksek										
	P01	P02	P03	P04	P05	P06	P07	P08	P09	P10
Tüm	4	4	5	4	4	4	4	5	3	4
Ö01	4	5	5	4	5	4	4	5	4	5
Ö02	4	4	5	4	3	4	4	5	4	5
Ö03	4	4	5	4	4	5	4	5	4	5
Ö04	4	4	5	4	4	3	3	5	4	5

Türk Hava Kurumu Üniversitesi