Ders Adı:	**Portföy Yönetimi**
Ders Kodu:	İşletme Yüksek Lisans Programı
Öğretim Eleman(lar)ı:	Öğr.Gör.Doç.Dr.K.Evren Bolgün
Yarıyıl Boyunca Toplam Ders Saati :	24 (8 hafta X 3 saat)
ECTS Kredisi:	3
Dersin Verildiği Yarıyıl :	1
Dersin Ön Koşul(ları):	Uluslararası Finansman, Finansal Risk Analizi & Yönetimi
Ders Özeti ve Amaçları:	Yatırım Dünyası, Finansal Yatırım Kararları, Portföy Seçimleri, Sermaye & Para Piyasaları, Yatırım Teorileri, Portföy Fiyatlama Modelleri, Risk & Getiri Analizleri, Finansal Değerleme Prensipleri, Menkul Kıymet Değerlemesi, Hisse Senetleri Piyasasında Portföy Analizi, Mikro & Makro Analizler, Sektör-Şirket Analizleri, Teknik Analiz, Tahvil Portföy Yönetimi & Analizi, Türev Piyasaları, Modern Portföy Yönetimi, Portföy Performans Yönetimi, Yatırım Fonlarında Risk& Getiri Analizi
Öğretim Metodu:	Görsel Teorik Anlatım & Deneysel Örnek Çalışmalar, Powerpoint Sunumlar, FİNNET Portfolio Advisor Program Uygulamaları
Notlandırma Sistemi:	Final: % 70 Portföy Yönetim Yarışması % 30
Sınav Şekli:	Final Sınavı
Sınav Sırasında Yardımcı Olacak Araçlar:	Fonksiyonel Hesap Makinesi
Kullanılan Ders Kitapları:	Ders Notları Karan,Mehmet Baha.(2004); Yatırım Analizi ve Portföy Yönetimi, Gazi Kitapevi Arman, Tevfik. .(2005) Hisse Senedi Değerlemesi, Literatür Yayıncılık Kapucu, Hakan. (2012) İMKB Uygulamalarıyla Portföy Modelleri, IJOPEC Yayıncılık
Önerilen Diğer Kaynaklar:	www.tcmb.gov.tr, www.bddk.org.tr, www.spk.gov.tr, www.vob.org.tr, www.treasury.gov.tr, www.bloomberg.com, www.tkyd.org.tr
Ders Konuları:	**HF.1-Portföy Yönetiminin Temel İlkeleri (I);** Kaynak:Arman Tevfik,Hisse Senedi Değerlemesi,sf.69 **HF.2-Portföy Yönetiminin Temel İlkeleri (II);** Kaynak:Arman Tevfik, Hisse Senedi Değerlemesi,sf.89 **HF.3-Portföy Modellemesi;** Kaynak: Hakan Kapucu, İMKB Uygulamalarıyla Portföy Modelleri,sf.5 **HF.4-Etkin Portföy Yönetimi**; Kaynak: Hakan Kapucu, İMKB Uygulamalarıyla Portföy Modelleri,sf.33 **HF.5-Portföy Yönetiminin Temel İlkeleri (I);** Kaynak:Arman Tevfik,Hisse Senedi Değerlemesi,sf.69

	HF.6-Faiz Oranları,Yapısı,Türleri; Kaynak: Karan,Mehmet Baha.; Yatırım Analizi ve Portföy Yönetimi,sf.109 **HF.7-Portföy Performansının Ölçülmesi;** Kaynak: Karan,Mehmet Baha.; Yatırım Analizi ve Portföy Yönetimi,sf.635

Portföy Yönetim Yarışması

Bu uygulama içerisinde FİNNET firmasının ticari olarak pazarlamakta olduğu **Portfolio Advisor 2.5** isimli finansal ürünü kullanılacaktır. Öğrenciler dersin sunulmaya başlanacağı 11 Nisan haftası içerisinde www.finnet.com.tr sitesi içerisinden (212)-556 74 78 no'lu telefon üzerinden şirket yetkilileri ile temasa geçerek programı temin etmek ve kişisel bilgisayarlarına **2 ay** yıl süre ile geçerli lisans şekli ile yüklemek durumundadır. Portföy programı üzerinden sadece hisse senedi ve repo ile ilgili risk/getiri tercihlerine uygun portföy dağılımları oluşturulacaktır. Öğrenciler 11 Nisan 2013 ile başlayan hafta içerisinde İMKB hisse senetleri pazarı içerisinden risk/getiri tercihlerine göre belirleyecekleri ağırlıklar ile hisse senedi portföyü üzerinden Toplam 100,000 TL'lik bir Yatırım Portföyü oluşturacaklardır. Oluşturulan portföye ait bilgiler "Portföy Durumu-Toplam Değer" şeklinde her hafta Perşembe akşamı basılı olarak da her hafta derse getirilecektir. Portföy yarışması 30 Mayıs son Final haftasında tamamlanacaktır. Çalışma süresince öğrenciler portföy içeriklerinde sadece ilgili hafta Perşembe 17:30 yurtiçi BİST piyasa kapanışı itibarıyla 1 kez değişiklik yapabilecek ve portföy dağılım ve değerlenen portföy bilgisi aynı gün içerisinde bir sonraki hafta Perşembe 17:30 saatine kadar sabit kalacaktır. İlgili hafta içerisinde iletilmeyen portföy bilgilerinin olması durumunda bir önceki haftanın portföyünün sabit kaldığı farz edilerek değerleme yapılması gerekmektedir. Yarışma kuralları uyarınca son hafta gerçekleşen en yüksek portföy değerine göre 1.,2. ve 3. Portföyler seçilerek notlandırma yapılacaktır.