

## Uygulamalı Portföy Yönetimi Teknikleri (2 Gün)

### AMAÇ

Seminerde, risk-getiri tercihleri doğrultusunda yatırımcıların portföy getiri hedefleri ve hisse senedi portföy sınırlamaları doğrultusunda ortalama-varyans optimizasyonu yapılmak suretiyle etkin sınır çerçevesinde uygulamalı risk analizleri hesaplanarak etkin hisse senedi dağılımları oluşturulmaktadır. Eğitimin amacı; yatırım teorisini tanıtmak, yatırım kararları alınırken dikkate alınması gereken hususlar hakkında bankacıları bilgilendirmek, portföy yönetimini gerek teorik gerekse de uygulama bazında detaylı olarak değerlendirmeyi içermektedir. Eğitim sonucunda hedeflenen, katılımcılara finansal piyasalara, finansal ürünlere, hisse senetlerine daha geniş bir bakış açısı (risk-getiri odaklı) ile bakmalarını, finans ve yatırım alanında günümüzdeki gelişmeleri daha iyi yorumlamalarını sağlamaktır.

### ODAK NOKTALARI

#Finansal Ürün Riskleri #Finansal Piyasalar #Portföy Yönetimi Teorileri # Portföy Risk Ölçümleri #

### EĞİTİMDEN BEKLENEN SONUÇLAR (ÖĞRETİMSSEL ÇIKTILAR/KAZANIMLAR)

**Bilir** : Portföy Yönetimi Teorilerini ve Portföy Risk Ölçümlemesini Bilir.

**Anlar** : Yatırımcı Risk-Getiri Tercihlerine Uygun Portföy Yönetimi Sonuçlarını Anlar.

**Yapar** : Optimum Portföy Dağılımını ve Portföy Risk Yönetimi İşlemlerini Yapar.

### KATILIMCILAR

Banka Fon Yönetimi, Portföy Yönetimi, Satış ve Pazarlama, Yatırım Danışmanlığı, Sermaye Piyasaları Bölümleri, Banka Şube çalışanlarına ve Bireysel Emeklilik Şirketleri çalışanlarına yöneliktir.

### İÇERİK

#### ■ Portföy Yönetimi

- Portföy Kavramı ► Portföy Yönetimi Süreci ► Portföy Çeşitleri ► Risk & Beklenen Getiri
- Yatırımcı Risk İştahı

#### ■ Yatırım Araçları, Finansal Risk-Getiri Hesaplamaları

- Finansal Varlıklarda Beklenen Getiri & Risk ► Yatırım Ürünleri

#### ■ Geleneksel Portföy Yönetimi

- Geleneksel Portföy Yönetimi Aşamaları
- Menkul Kıymet Seçimi

#### ■ Modern Portföy Yönetimi

- Modern Portföy Teorisi Temelleri ► Yatırımcı Tercihleri ► Ortalama-Varyans ve Portföy Seçimi ► Markowitz Portföy Çeşitlendirmesi ► Etkin Portföy ve Optimal Portföy Seçimi

#### ■ Faktör Modelleri

- Finansal Varlık Fiyatlandırma Modeli ► Menkul Kıymetlerde Fazla/Düşük Fiyatlandırma
- Sermaye Piyasası Doğrusu ve Piyasa Portföyü ► Arbitraj Fiyatlandırma Teorisi ► FAMA ve FRENCH 3 Faktör Modeli

#### ■ Portföy Oluşturmada Temel ve Teknik Analiz Kullanımı

- Temel ve Teknik Analizin Önemi ► Temel Analiz Kriterleri ► Firma Analizi ► Finansal Analiz
- Teknik Analiz ► Temel ve Teknik Analiz Farkları ► Rassal Yürüyüş ve Etkin Piyasalar Hipotezi

#### ■ Portföy Yönetimi Stratejileri

- Pasif Portföy Yönetimi ► Aktif Portföy Yönetimi ► Satın Al ve Elde Tut Stratejisi ► Maliyeti Ortalama Stratejisi ► Sabit Değer Stratejisi ► Sabit Oran Stratejisi ► Değişken Oran Stratejisi
- Endeks Fon Stratejisi ► Portföy Sigortası

#### ■ Portföy Performansının Ölçülmesi

- Sharpe Oranı ► Treynor Endeksi ► Jensen Ölçütü ► Sortino Oranı ► Performans Ölçüm Yöntemlerinin Eleştirisi ► Piyasa Zamanlaması

■ **BİST30 Hisse Senedi Portföyü Üzerine Portföy Yönetimi Uygulaması**

► Hisse Senedi Portföy Optimizasyonu ► Risk Bazlı Etkin Sınır Analizi ► Optimum Portföy Risk Metrikleri ► Risk Bazlı Varlık Dağılımı

■ **Sonuç ve Değerlendirme**

<b><u>Kendini Yönetme</u> Davranışsal Yetkinlikler</b>	<b><u>Ekibini Yönetme</u> Yönetimsel Yetkinlikler</b>	<b><u>İşini Yönetme</u> Mesleki/Bankacılık Teknik Yetkinlikler</b>	<b><u>Geleceği Yönetme</u> Öz-Gelecek Yetkinlikleri</b>
DY01 MESLEKİ GELİŞİM VE YENİLENME	YY01 HIZLI KARAR ALMA VE ÇEVİKLİK	MTY04 MALİYET	GY03 DİJİTAL OKUR-YAZARLIK
DY07 MÜŞTERİ DUYARLILIĞI	YY02 PLANLAMA VE ORGANİZASYON	MTY05 FİYATLAMA	GY04 DEĞİŞİM VE DÜŞÜNCE LİDERLİĞİ
DY09 ANALİTİK DÜŞÜNME VE YARATICILIK	YY08 SONUÇ ODAKLILIK	MTY09 RAPORLAMA VE SUNUM	GY08 ÖĞRENME STRATEJİLERİ
	YY10 DENETLEME	MTY10 KIYASLAMA	

Eğitim içerik tasarım ve şablonu TBB'ye aittir. Hiçbir şekilde kopyalamaz, dağıtılamaz ve yayınlanamaz ve üçüncü şahıslarla paylaşamaz.