



AYDIN ADNAN MENDERES ÜNİVERSİTESİ DERS BİLGİ FORMU

Dersin Adı		Menkul Kıymet Analizi ve Portföy Yönetimi							
Ders Kodu		YBS364		Ders Düzeyi		Lisans			
AKTS Kredi	6	İş Yüğü	150 (Saat)	Teori	3	Uygulama	0	Laboratuvar	0
Dersin Amacı		Dersin temel amacı öğrencilere finansal piyasalarda yatırım yapma ile ilgili temel kavramları, araçları ve prensipleri öğretmektir. Öğrencilerin, teorik yöntemler aracılığı ile menkul kıymet seçimi, portföy yönetilmesi ve yatırım değerlendirmesi konularında bilgi sahibi olmalarının sağlanması hedeflenmektedir. Çeşitli problem çözümleri ile öğrencilerin yatırım yapma ve portföy oluşturma becerilerinin geliştirilmesi amaçlanmaktadır.							
Özet İçeriği		Yatırım ortamı ve piyasanın oyuncuları; menkul kıymet borsaları-Türkiye’de sermaye piyasası faaliyetleri, faiz oranları, paranın zaman değeri; portföy risk ve getirisi; portföy seçimi; sermaye varlıklarını fiyatlama modeli (SVFM); faktör modelleri; arbitraj fiyatlama teorisi; etkin piyasalar hipotezi ve anomaliler; hisse senetleri ve İMKB hisse senedi piyasasında alım satım işlemleri; hisse senetlerinin değerlemesi; tahviller, temel analiz; teknik analiz; portföy yönetim stratejileri; vadeli işlem sözleşmeleri; opsiyon sözleşmeleri ve opsiyon değerlemesi.							
Staj Durum		Yok							
Öğretim Yöntemleri		Anlatım (Takrir), Tartışma, Bireysel Çalışma							
Dersi Veren Öğretim Elemanı(ları)									

Ölçme ve Değerlendirme Araçları

Araç	Adet	Oran (%)
Ara Sınav (Vize)	1	40
Dönem Sonu Sınavı (Final)	1	70

Ders Kitabı / Önerilen Kaynaklar

1	Turhan Korkmaz ve Ali Ceylan, Sermaye Piyasası ve Menkul Değer Analizi, Ekin Kitabevi.
2	Ali Ceylan ve Turhan Korkmaz, Finansal Teknikler, Ekin Kitabevi.

Hafta	Haftalara Göre Ders Konuları	
1	Teorik	Reel Ve Finansal Varlıklar
2	Teorik	Finansal Piyasalar ve Ekonomi Piyasa Oyuncuları
3	Teorik	Finansal Piyasalar ve Ekonomi Piyasa Oyuncuları
4	Teorik	Varlık Çeşitleri ve Finansal Enstrümanlar
5	Teorik	Menkul Kıymet Piyasaları
6	Teorik	Risk ve Getiri
7	Teorik	Örnek Soru Çözümü Yapılması
8	Teorik	Örnek Soru Çözümü Yapılması
9	Ara Sınav (Vize)	Ara Sınav
10	Ara Sınav (Vize)	Ara Sınav
11	Teorik	Etkin Varlık Çeşitlendirmesi
12	Teorik	Etkin Varlık Çeşitlendirmesi
13	Teorik	Sermaye Varlıklarını Fiyatlandırma Modeli ve Arbitraj Fiyatlama Teorisi
14	Teorik	Sermaye Varlıklarını Fiyatlandırma Modeli ve Arbitraj Fiyatlama Teorisi
15	Teorik	Genel Değerlendirme

Dersin Öğrenme, Öğretme ve Değerlendirme Etkinlikleri Çerçevesinde İş Yüğü Hesabı (Ortalama Saat)

Etkinlik	Adet	Ön Hazırlık	Etkinlik Süresi	Toplam İş Yüğü
Kuramsal Ders	13	2	3	65
Ödev	13	2	0	26
Bireysel Çalışma	13	2	0	26
Kısa Sınav	2	4	1	10
Ara Sınav	1	9	1	10



Dönem Sonu Sınavı	1	12	1	13
Toplam İş Yüğü (Saat)				150
Yuvarla [Toplam İş Yüğü (saat) / 25*] = AKTS Kredisi				6
*25 saatlik iş yüğü 1 AKTS olarak kabul edilmektedir.				

Dersin Öğrenme Çıktıları

1	Para ve sermaye piyasası arasındaki farkı, endeks hesaplarını ve türev piyasası araçlarını açıkça tanımlayabilecektir.
2	Menkul kıymet piyasalarında halka arzın nasıl yapıldığını, hisse senetlerinin nasıl işlem gördüğünü ve açığa satışın nasıl yapıldığını değerlendirebilecektir.
3	Finansal varlıklarında getiri ve risk kavramları hakkında bilgi verebilecektir.
4	Finansal piyasalarda işlem gören menkul kıymetler ve değerlemesi hakkında bilgi sahibi olur
5	Portföy teorisi ve risk azaltımı stratejilerini öğrenir

Program Çıktıları (Yönetim Bilişim Sistemleri Programı)

1	Yönetim Bilişim Sistemleri alanı ile ilgili kavramları ve kavramlar arası ilişkileri açıklar.
2	İşletmeler için gerekli yazılımların neler olduğunu belirler, gerektiğinde ağı kurar, sistemleri belirler, teknolojiye gelişimi izleyerek bilişim sistemini günceller.
3	Bilimsel bilginin üretimi, işlenmesi, depolanması, iletilmesi ve kullanılması gibi konularda süreçler ile yöntem ve teknikleri bilir.
4	Bilginin iletildiği ortam ve araçları tanır ve kullanabilir.
5	Çeşitli organizasyonlar, bilgi işlem merkezleri ve alanla ilgili diğer kuruluşların yapısal, yönetsel ve teknik özelliklerini tanır.
6	Bilgi gereksiniminden başlayarak arama, bulma, kullanma ve iletme gibi temel alan becerilerine sahiptir.
7	Analiz ve senteze yönelik düşünme yeteneğine sahiptir. Farklı örgüt kültürleri ve örgüt yapıları için strateji-yapı alternatiflerini belirler ve amaca uygun strateji hazırlar.
8	Bilgi kaynaklarını tanıma, niteliklerini değerlendirme ve bilgi sistemlerini kurma ve yönetme becerisine sahiptir. Temel işletme bilgi sistemlerini (üretim, pazarlama, tedarik ve lojistik, insan kaynakları, muhasebe, finans) bilir ve kullanır.
9	Örgütlerin yönetim, üretim, finans, pazarlama gibi temel işletme işlevlerini anlar, yönetim ilkelerini açıklar, ekonomik kayıpları ve nedenlerini ortaya çıkartarak çözümler üretir. Örgütlerde verimlilik ve etkinliği artırmak için çalışmalar yapar.
10	Mesleki etik ilkelerini ve hukuksal düzenlemeleri bilir ve onlara uygun davranır.
11	Veri tabanı, teknoloji trendleri, ekonomi, e-ticaret, mobil ticaret ve yazılım projelerinin yönetimini bilir ve kullanır. Veritabanı yönetim sistemlerini kullanabilir.
12	Temel network kavramlarını öğrenir ve sunucu işletim sistemlerini kullanabilir.
13	Yönetim Bilişim Sistemleri alanındaki bilimsel araştırmaları izleyerek proje ve etkinlikler geliştirir veya onlara katkı sağlar. Bilgisayar ortamında proje yönetebilir.
14	Yönetim Bilişim sistemleri ile ilgili konularda düşüncelerini ve sorunlara ilişkin çözüm önerilerini nicel ve nitel verilerle destekleyerek uzman olan ve olmayan kişilerle paylaşır.
15	İşletme faaliyetlerinden ve çevresinden gelen veriyi depolayan, birleştiren, raporlayan ve analiz eden bilgi teknolojileri alt yapısını kurar ve geliştirir.

Program ve Öğrenme Çıktıları İlişkisi 1:Çok Düşük, 2:Düşük, 3:Orta, 4:Yüksek, 5:Çok Yüksek

	ÖÇ1	ÖÇ2	ÖÇ3
PÇ7	2	3	3
PÇ10	5	4	4

