AYDIN ADNAN MENDERES ÜNİVERSİTESİ
DERS BİLGİ FORMU

Dersin Adı	Sermaye Piyasası Analizi ve Portföy Yönetimi								
Ders Kodu	UTİ413		Ders Düzeyi	Lisans					
AKTS Kredi	6	İş Yükü	150 *(Saat)*	Teori	3	Uygulama	0	Laboratuvar	0
Dersin Amacı	Globalleşme sürecinde, dünyada finans piyasaları gün geçtikçe daha büyük bir öneme sahip olmaktadır. Bu piyasalarda birçok finansal enstrüman işlem görmektedir. Bu dersin amacı, öğrencilerin bu enstrümanlara yatırım yaparken kullanacakları bilimsel analiz yöntemlerinin öğretilmesi ve onların rasyonel bir yatırımcı zihniyetine sahip olmasını sağlamaktır.								
Özet İçeriği	Finansal Piyasalar, Sermaye Piyasaları, Hisse Senedi Piyasaları, Türev Piyasalar, SPK, İMKB, VOB Menkul kıymet kavramı Portföy tanımı, geleneksel portföy teorisi ve modern portföy teorisi Etkin piyasalar kuramı Markowitz portföy teorisine giriş Portföy getirisinin ve riskinin ölçümü ve etkin sınırın oluşturulması Sermaye varlıklarını fiyatlama modeline (SVFM) giriş Arbitraj fiyatlama modeli Portföy performansının değerlendirilmesi . Aktif Pasif portföy yönetimi Uluslar arası çeşitlendirme.								
Staj Durum	Yok								
Öğretim Yöntemleri	Anlatım (Takrir), Tartışma, Bireysel Çalışma								
Dersi Veren Öğretim Elemanı(ları)	Dr. Öğr. Üyesi Zeliha CAN ERGÜN								

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

Ders Kitabı / Önerilen Kaynaklar	
1	Mehmet Baha Karan, Yatırım Analizi ve Portföy Yönetimi, Gazi Kitabevi, Ankara.

Hafta	Haftalara Göre Ders Konuları	
1	Teorik	Sermaye Piyasası Analizi ve Portföy Yönetimi Dersine Giriş
2	Teorik	Finansal Piyasalar
3	Teorik	Finansal Araçlar
4	Teorik	Menkul Kıymet Borsaları
5	Teorik	Faiz Oranları ve Paranın Zaman Değeri
6	Teorik	Faiz Oranları ve Paranın Zaman Değeri
7	Teorik	Portföy Risk ve Getirisi
8	Teorik	Portföy Risk ve Getirisi
9	Ara Sınav (Vize)	Ara Sınav
10	Ara Sınav (Vize)	Ara Sınav
11	Teorik	Sermaye Varlıklarını Fiyatlama Modeli (CAPM)
12	Teorik	Sermaye Varlıklarını Fiyatlama Modeli (CAPM)
13	Teorik	Etkin Piyasalar Hipotezi
14	Teorik	Hisse Senetleri ve Tahvil Değerlemesi
15	Teorik	Hisse Senetleri ve Tahvil Değerlemesi
16	Dönem Sonu Sınavı (Final)	Final

Dersin Öğrenme, Öğretme ve Değerlendirme Etkinlikleri Çerçevesinde İş Yükü Hesabı (Ortalama Saat)				
Etkinlik	Adet	Ön Hazırlık	Etkinlik Süresi	Toplam İş Yükü
Kuramsal Ders	13	0	3	39
Bireysel Çalışma	13	0	4	52
Ara Sınav	1	28	1	29

Dönem Sonu Sınavı	1	29	1	30
			Toplam İş Yükü (Saat)	150
			Yuvarla [Toplam İş Yükü (saat) / 25*] = **AKTS Kredisi**	6
**25 saatlik iş yükü 1 AKTS olarak kabul edilmektedir.*				

Dersin Öğrenme Çıktıları	
1	Yatırım ürünleri ve yatırım kurumları konusunda bilgi kazanır.
2	Menkul kıymetlerin getirisini ve riskini hesaplayabilir.
3	Portföy oluşturarak, portföy riskini ve portföy getirisini hesaplayabilir.
4	Temel analiz ve teknik analiz gerçekleştirebilir.
5	portföy yönetimi yapabilir ve portföy performansının ölçülmesini sağlayabilir. 6

Program Çıktıları *(Uluslararası Ticaret ve İşletmecilik Programı)*	
1	Ulusal ve Uluslararası piyasalarda yetkin olarak görev yapabilecek orta ve üst düzey yönetici adayı yetiştirmektir.
2	Öğrencilerimiz teorik derslerin yanı sıra uygulamaya yönelik, proje bazlı dersler alabilmektedir.
3	Öğrencilerimiz öğrenimleri sırasında sektörle ilişkiler kurmakta ve iş olanakları elde etmektedir.
4	Bölümümüzün akademik programında yer alan Avrupa ve Asya Ekonomileri, Küresel Ticaret ve Yatırım Uygulamaları, Avrupa Birliği İşletme Politikaları, Farklı Kültürlerle Ticaret Koşulları, İhracat-İthalat, Gümrük Mevzuatları, Dış Ticaret Finansmanı, Emlak Değerleme Mevzuatı gibi önemi giderek artan konularla ilgili dersler verilmekte ve buna paralel olarak ders programları sürekli olarak güncellenmektedir.
5	Bölümümüzün mezunları dış ticaret firmaları, çokuluslu şirketler, banka ve sigorta şirketleri, perakende sektörü, reklam ajansları ve lojistik firmalarında orta ve üst düzey yönetici olarak iş yaşamına katılabilmektedir.
6	Uluslararası Ticaret alanında teorik ve uygulamalı düzeyde ileri derecede bilgi sahibi olmak, bu bilgileri kullanabilmek.
7	Uluslararası Ticaret ve Ekonomi ile ilgili temel kavram, fikir ve verileri bilimsel yöntemlerle inceleyebilmek, eleştirel ve analitik bakış açısı ile yorumlayabilmek ve ekonomik olay ve gelişmelerle ilişkilendirerek değerlendirebilmek.
8	Uluslararası Ticaret ile ilgili konularda düşünce, yorum ve değerlendirmelerini yazılı ve sözlü olarak aktarabilmek.
9	Uluslararası Ticaret kavramı ile bağlantılı kamu kurumları ve özel sektör kuruluşlarının, nasıl işlediğini anlamak ve bu alandaki süreklilikleri ve değişiklikleri tespit edebilmek.
10	Uluslararası Ticaret ile ortak çalışma içerisinde olan disiplinlere (örneğin; iktisat, hukuk, finans, uluslararası işletme vb) ilişkin temel bilgilere sahip olmak ve bu bilgileri kullanabilmek.
11	Uluslararası Ticaret, Küreselleşme ve Finansman sistemleri ile ilgili İngilizce yayın ve araştırmaları izleyebilmek ve meslektaşları ile uluslararası alanda iletişim kurabilmek.
12	Veri toplanması, yorumlanması ve duyurulması aşamalarında bilimsel ve etik değerlere sahip olmak.
13	Yerel, bölgesel (örneğin Avrupa Birliği ve Orta Doğu) ve küresel gelişmeleri politik ekonomik açıdan tanımlayabilmek, takip edebilmek ve bu gelişmeler arasında ilişki kurabilmek.
14	Uluslararası Ticaret alanında teorik ve uygulamalı düzeyde ileri derecede bilgi sahibi olmak, bu bilgileri kullanabilmek.
15	İkinci bir dili orta düzeyde kullanabilmek.

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

	ÖÇ1	ÖÇ2	ÖÇ3	ÖÇ4	ÖÇ5
PÇ1	2	2	3	3	3
PÇ2	3	2	3	3	5
PÇ3	2	3	5	3	4
PÇ4	4	3	5	5	5
PÇ5	5	3	5	3	4
PÇ6	5	4	5	5	5
PÇ7	5	3		4	4
PÇ8	5	5	4	5	5
PÇ9	5	4	5	5	5
PÇ10	4	5	5	5	4
PÇ11	3	4	4	3	5
PÇ12	5	2	5	5	4
PÇ13	4	2	5	4	5
PÇ14	3	5	5	5	5
PÇ15	5	5	5	5	3