



AYDIN ADNAN MENDERES ÜNİVERSİTESİ
SÖKE İŞLETME FAKÜLTESİ
İŞLETME BÖLÜMÜ
İŞLETME PROGRAMI
DERS BİLGİ FORMU

Dersin Adı	Sermaye Piyasası Analizi ve Portföy Yönetimi								
Ders Kodu	İŞLT403			Ders Düzeyi			Lisans		
AKTS Kredi	5	İş Yüğü	125 (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 <input type="checkbox"/> Pasif portföy yönetimi Uluslar arası çeşitlendirme.								
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	60

Ders Kitabı / Önerilen Kaynaklar

9	Arman TEVFİK ve Gürman TEVFİK, Menkul Değer Yatırımlarına Giriş, Ekonomik Araştırmalar Merkezi Yayınları, İstanbul, 1999
---	--

Hafta	Haftalara Göre Ders Konuları	
1	Teorik	Menkul Kıymet Analizi Dersine Giriş
2	Teorik	Paranın Zaman Değeri: Gelecek değer ve anüitelerin gelecek değeri kavramları, Temel Analiz
3	Teorik	Temel Analiz
4	Teorik	Hisse Senedi Değerlemesi
5	Teorik	Tahvil Değerlemesi
6	Teorik	Menkul Kıymet Analizinde Risk ve Getiri Ölçümü
7	Teorik	Menkul Kıymet Analizinde Risk ve Getiri Hesaplamaları Ölçümü
8	Teorik	Modern Portföy Yaklaşımı
9	Ara Sınav (Vize)	Ara Sınav
10	Ara Sınav (Vize)	Ara Sınav
11	Teorik	Geleneksel Portföy Yaklaşımı
12	Teorik	Sermaye Varlıklarını Fiyatlandırma Modeli ve Arbitraj Fiyatlama Modeli
13	Teorik	Teknik Analiz
14	Teorik	Seçilmiş Diğer Değerleme ve Analiz Yöntemleri
15	Teorik	Para piyasası araçları 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	0	3	39
Bireysel Çalışma	13	0	2	26
Ara Sınav	1	27	1	28
Dönem Sonu Sınavı	1	31	1	32
Toplam İş Yüğü (Saat)				125
Yuvarla [Toplam İş Yüğü (saat) / 25*] = AKTS Kredisi				5

*25 saatlik iş yüğü 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.

Program Çıktıları (İşletme Programı)

1	İşletme alanı ile ilgili güncel bilgileri içeren ders kitapları, uygulama araç-gereçleri ve diğer kaynaklarla desteklenen ileri düzeydeki kuramsal ve uygulamalı bilgilere sahip olur; bu bilgileri uzmanlık düzeyinde geliştirebilir ve derinleştirebilir; gerektiğinde işletme alanında yenilik getirecek özgün tanım ve sentezlere ulaşabilir.
2	İşletme alanındaki temel ve ileri düzeydeki kuramsal ve uygulamalı bilgileri, sistematik bir yaklaşımla kullanabilir, yorumlayabilir ve değerlendirebilir; gerektiğinde yeni bilgiler üretebilir.
3	İşletme alanında edindiği bilgi ve becerileri kullanarak olguları, verileri yorumlayabilir, değerlendirebilir, sorunları tanımlayabilir, analiz edebilir, araştırmalara ve kanıtlara dayalı çözüm önerileri geliştirebilir. Bu bilgileri farklı disiplin alanlarından gelen bilgilerle birleştirerek yeni bilgiler oluşturabilir; gerektiğinde işletme alanına yenilik getiren, bir düşünce, yöntem, tasarım ve/veya uygulama geliştirebilir ya da bilinen bir düşünce, yöntem, tasarım ve/veya uygulamayı işletme alanına uyarlayabilir.
4	İşletme alanı ile ilgili sorunları, bilimsel araştırma yöntemleri kullanarak çözümlenebilir, bu sorunların çözümüne yönelik projeler geliştirebilir, bu amaçla bireysel ve ekip üyesi olarak çalışabilir; gerektiğinde liderlik yapabilir.
5	İşletme alanı ile ilgili bilgi ve becerileri, eleştirel bir yaklaşımla değerlendirebilir; gerektiğinde üretici ve eleştirel düşünme, sorun çözme ve karar verme gibi üst düzey zihinsel süreçleri kullanabilir, alanı ile ilgili olguları yorumlayabilir.
6	İşletme alanı ile ilgili veya alan dışı kişi ve grupları, işletme alanı ile ilgili konularda bilgilendirebilir; nitel ve nicel veriler kullanarak yazılı, sözlü ve görsel olarak sistemli bilgi aktarabilir; gerektiğinde uzman kişiler ile alanındaki konuların tartışılmasında özgün görüşlerini savunabilir, alanındaki yetkinliğini gösteren etkili iletişimi kurabilir.
7	Toplumsal, bilimsel, kültürel ve etik değerlere uygun hareket ederek, işletme alanı ile ilgili veriler toplayabilir, yorumlayabilir, uygulayabilir ve ulaştığı sonuçları duyurabilir; gerektiğinde bu sayede işletme alanındaki bilimsel, teknolojik, sosyal veya kültürel ilerlemeleri tanıtarak, yaşadığı toplumun bilgi toplumu olma ve bunu sürdürbilme sürecine katkıda bulunabilir.
8	İşletme alanı ile ilgili konularda strateji, politika ve uygulama planları geliştirebilir ve elde edilen sonuçları, kalite süreçleri çerçevesinde değerlendirebilir.
9	İşletme alanında özümstedikleri bilgiyi, problem çözme ve/veya uygulama becerilerini, disiplinler arası çalışmalarda kullanabilir.
10	İşletme alanı ile ilgili konularda karşılaşılan toplumsal, bilimsel, kültürel ve etik sorunların çözümüne katkıda bulunabilir ve bu değerlerin gelişimini destekleyebilir.
11	Kalite, iş etiği ve sosyal sorumluluk, çevre koruma, iş sağlığı ve güvenliği, sosyal haklar ve sosyal adalet bilincini kazanır ve görev aldığı işletmelerde bu bilinçle iş yapma ve sonuçlandırma becerisine sahip olur.
12	İşletme alanının alt disiplinleri olan yönetim, pazarlama, finans, üretim, sayısal yöntemler ve muhasebe konularında ileri düzeyde bilgilere sahiptir. Bu bilgileri kullanmak suretiyle çalışma yaşamındaki verileri analiz edebilme, yorumlayabilme ve çözüm önerileri getirebilme becerisi kazanır.
13	Yürütücüsü veya katılımcısı olduğu projelerde sorumluluk alır. Görev aldığı organizasyon için amaç ve hedef belirler.
14	Yenilik ve değişikliğe açık olma, girişimcilik, liderlik, analitik ve eleştirel düşünme becerisine sahip olur.
15	Yaşam boyu öğrenme bilincini kavrar.

