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 *(Ekonomi Programı)*	
1	Temel iktisadi kavramları, teorileri, yöntemleri tanımlar ve değerlendirir.
2	Güncel ekonomik sorunlar karşısında temel düzeyde politika önerileri sunar.
3	Ekonomik ve sosyal olayları tarihsel bir perspektif çerçevesinde yorumlar.
4	İktisadi aktörlerin (devlet, firma, hanehalkı gibi) ekonomi içerisindeki rollerini açıklar.
5	Ulusal ve uluslararası ekonomik göstergeleri ve gelişmeleri takip eder, ekonomik bilgi ve yöntemlerini farklı alanlarda kullanır.
6	Ekonomik verilerin analiz edilmesi ve modellenmesi için gerekli olan yöntemleri, teknikleri ve araçları sağlar ve elde edilen sonuçları değerlendirir.
7	İktisadi sistemleri, karar mekanizmalarını, politikaları ve sorunları tanımlar ve bunlar hakkında yorum yapar.
8	Ekonomi alanına temel oluşturan diğer disiplinlerden yararlanır ve bu disiplinlere ilişkin temel bilgilere sahip olur.
9	İktisadi büyüme, kalkınma ve verimlilik sorunlarını temel düzeyde açıklar ve yorumlar.
10	Kamu, endüstri, tarım, çevre ve doğal kaynaklar, çalışma, bilgi ve mülkiyet ekonomileri, uluslararası finans, para, politik iktisat ve ekonometrik yöntemler gibi alanlardan kendilerinin seçtiği ekonominin alt dallarında yeterli bilgiye sahip olur.
11	İşletme kavramlarını temel düzeyde tanımlar ve değerlendirir.
12	Gerek kamunun gerekse de özel kesimin gereksinim duyduğu yüksek becerili elemanlarda olması gereken yeterli düzeyde hukuk bilgisine sahip olur.
13	Yenilik, yaratıcılık ve teknoloji kavramlarının dinamik küresel ekonomi içerisindeki rolünü tanımlar.
14	Gelecekteki istihdam olanakları ve çalışma ortamı için faydalı olabilecek becerileri gösterir.
15	Mesleki ve etik sorumluluk bilincine sahip rasyonel bir birey olarak bilimi rehber edinir.

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

	ÖÇ1	ÖÇ2	ÖÇ3	ÖÇ4	ÖÇ5
PÇ6	2	3	2	2	3
PÇ8	3	3	2	2	3
PÇ11	4	3	3	2	3