



AYDIN ADNAN MENDERES ÜNİVERSİTESİ
SOSYAL BİLİMLER ENSTİTÜSÜ
İŞLETME ANABİLİM DALI
İŞLETME MUHASEBE VE FİNANSMAN PROGRAMI
İŞLETME MUHASEBE VE FİNANSMAN YÜKSEK LİSANS PROGRAMI
DERS BİLGİ FORMU

Dersin Adı	Finansal Yatırımların Analizi ve Portföy Yönetimi								
Ders Kodu	İMF501			Ders Düzeyi		Yüksek Lisans			
AKTS Kredi	5	İş Yüğü	127 (Saat)	Teori	3	Uygulama	0	Laboratuvar	0
Dersin Amacı	Bu ders bitiminde öğrenci yatırım araçlarını, sermaye piyasalarını, para piyasalarını, risk ve risk çeşitlerini; etkin piyasayı anlama, portföy kurma, uygulamalı portföy yönetimi, temel analiz yapabilme, teknik analizi anlama, portföy performanslarını ölçebilme ve türevleri anlama yeteneğine sahip olacaktır.								
Özet İçeriği	Sermaye Piyasaları, Para Piyasaları, Hisse senedi, tahvil ve diğer finansal enstrümanların incelenmesi; oluşturma teknikleri, dağılım teknikleri uygulamaları (Türkiye ve dünya sermaye piyasaları örneklemeleri ile).								
Staj Durum	Yok								
Öğretim Yöntemleri	Anlatım (Takrir), Tartışma								
Dersi Veren Öğretim Elemanı(ları)	Prof. Dr. Yusuf KADERLİ								

Ölçme ve Değerlendirme Araçları

Araç	Adet	Oran (%)
Ara Sınav (Vize)	1	40
Dönem Sonu Sınavı (Final)	1	60

Ders Kitabı / Önerilen Kaynaklar

1	Mehmet Baha Karan, Yatırım Analizi ve Portföy Yönetimi, Gazi Kitabevi, 2001.
---	--

Hafta	Haftalara Göre Ders Konuları	
1	Teorik	Finansal Varlıkların Özellikleri
	Ön Hazırlık	Investment Analysis and Portfolio Management, M. Ranganatham, R. Madhumathi, Dorling Kindersley Ltd, Singopare, 2005.
2	Teorik	Finansal Marketler, Yatırım Çeşitleri ve Özellikleri
	Ön Hazırlık	Investment Analysis and Portfolio Management, M. Ranganatham, R. Madhumathi, Dorling Kindersley Ltd, Singopare, 2005.
3	Teorik	Hedging
	Ön Hazırlık	Investment Analysis and Portfolio Management, M. Ranganatham, R. Madhumathi, Dorling Kindersley Ltd, Singopare, 2005.
4	Teorik	İkincil Piyasalar
	Ön Hazırlık	Investment Analysis and Portfolio Management, M. Ranganatham, R. Madhumathi, Dorling Kindersley Ltd, Singopare, 2005.
5	Teorik	Borsa Yönetimi ve Denetimi
	Ön Hazırlık	Investment Analysis and Portfolio Management, M. Ranganatham, R. Madhumathi, Dorling Kindersley Ltd, Singopare, 2005.
6	Teorik	Mali Aracı Çeşitleri
	Ön Hazırlık	Investment Analysis and Portfolio Management, M. Ranganatham, R. Madhumathi, Dorling Kindersley Ltd, Singopare, 2005.
7	Teorik	Yatırım Fırsatları
	Ön Hazırlık	Investment Analysis and Portfolio Management, M. Ranganatham, R. Madhumathi, Dorling Kindersley Ltd, Singopare, 2005.
8	Ara Sınav (Vize)	Ara Sınavlar
9	Teorik	Borç Araçları ve Borç Araçlarının Değerlemesi
	Ön Hazırlık	Investment Analysis and Portfolio Management, M. Ranganatham, R. Madhumathi, Dorling Kindersley Ltd, Singopare, 2005.
10	Teorik	Tahvil Araçları ve Değerlemesi
	Ön Hazırlık	Investment Analysis and Portfolio Management, M. Ranganatham, R. Madhumathi, Dorling Kindersley Ltd, Singopare, 2005.
11	Teorik	Türev Araçlar ve Değerlemesi



11	Ön Hazırlık	Investment Analysis and Portfolio Management, M. Ranganatham, R. Madhumathi, Dorling Kindersley Ltd, Singopare, 2005.
12	Teorik	Portföy Seçimi
	Ön Hazırlık	Investment Analysis and Portfolio Management, M. Ranganatham, R. Madhumathi, Dorling Kindersley Ltd, Singopare, 2005.
13	Teorik	Portföy Yönetimi
	Ön Hazırlık	Investment Analysis and Portfolio Management, M. Ranganatham, R. Madhumathi, Dorling Kindersley Ltd, Singopare, 2005.
14	Teorik	Portföy Performansı Tahminleme
	Ön Hazırlık	Investment Analysis and Portfolio Management, M. Ranganatham, R. Madhumathi, Dorling Kindersley Ltd, Singopare, 2005.
15	Ön Hazırlık	Investment Analysis and Portfolio Management, M. Ranganatham, R. Madhumathi, Dorling Kindersley Ltd, Singopare, 2005.
16	Dönem Sonu Sınavı (Final)	Final Sınavı
17	Dönem Sonu Sınavı (Final)	Final Sınavı

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

Etkinlik	Adet	Ön Hazırlık	Etkinlik Süresi	Toplam İş Yükü
Kuramsal Ders	14	2	3	70
Ara Sınav	1	25	1	26
Dönem Sonu Sınavı	1	30	1	31
Toplam İş Yükü (Saat)				127
Yuvarla [Toplam İş Yükü (saat) / 25*] = AKTS Kredisi				5

*25 saatlik iş yükü 1 AKTS olarak kabul edilmektedir.

Dersin Öğrenme Çıktıları

1	Öğrenciye Finans teorilerini anlama yeteneği kazandırma
2	Öğrenciye portföy kurma, uygulamalı portföy yönetimi, temel analiz yapabilme, teknik analizi anlama yeteneklerini kazandırma.
3	Öğrenciye türevleri anlama yeteneğini kazandırma.
4	Borç Araçları ve Borç Araçlarının Değerlemesini öğrenme
5	Tahvil Araçları ve Değerlemesini öğrenme

Program Çıktıları (İşletme Muhasebe ve Finansman Yüksek Lisans Programı)

1	Temel muhasebe bilgisi ve denetim ile ilgili hukuk dallarını bağdaştırabilme
2	Maliyet sistemleri kurulması ve geliştirilmesi ile ilgili teknik ve teorik bilgiler ile uygulamaya dönük çalışma yapma
3	İş hayatında aldığı kararlarda sosyal sorumluluk bilincini ve etik değerleri göz önünde bulundurabilme
4	Değişen iş koşullarında inisiyatif alma, analitik ve yaratıcı yaklaşımlarla sorun çözebilme ve riski yönetebilme
5	Menkul kıymetler ve diğer organize piyasalardaki açıklanması zor hareketlerin insan psikolojisine dayandırılması ve aradaki ilişkinin incelenmesi
6	Edindiği teorik bilgileri uygulama ile bütünleştirerek içinde çalıştığı sistemin geliştirilmesine katkıda bulunma (Mesleğin sorunlarını anlayıp yorumlayarak, fikirlerini sözlü ve/veya yazılı, açık ve öz bir şekilde ifade edebilme becerisi
7	Türev ürünleri, döviz piyasaları ve uluslararası finansal pazarlarda gelişen olayları analiz edebilme ve yorumlama, bu piyasalarda türev ürünlerle işlem yapabilme
8	Temel finans ilkelerini karar alma sürecine uygulamak için matematiksel ve istatistik bilgisinden yararlanma, ekonometrik modellerin muhasebe finansman alanında uygulanması ve finans piyasalarındaki güncel veriler üzerinde test edebilme
9	Uluslararası finansal yönetim araçlarını, uluslararası finansal piyasaları ve aracı kurum ve kuruluşları tanıma ve bir şirketin finans yönetiminde gerektiği yerlerde bütün bunlardan yararlanma
10	Finansal piyasaları etkileyen küresel ve/veya yerel kriz durumlarını neden-sonuç ilişkisi içerisinde değerlendirme ve bu tür kriz ortamlarında bilgiye dayalı karar alma

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

	ÖÇ1	ÖÇ2	ÖÇ3	ÖÇ4	ÖÇ5
PÇ1	4	4	3	3	3
PÇ2	3	3	3	3	4
PÇ3	2	4	5	2	2
PÇ4	4	2	4	2	2



PÇ5	5	5	4	4	3
PÇ6	2	3	4	2	3
PÇ7	3	2	5	3	3
PÇ8	4	2	4	3	4
PÇ9	4	4	3	4	4
PÇ10	5	2	4	3	3

