



**AYDIN ADNAN MENDERES ÜNİVERSİTESİ**  
**SOSYAL BİLİMLER ENSTİTÜSÜ**  
**EKONOMİ VE FİNANS ANABİLİM DALI**  
**EKONOMİ VE FİNANS (DİSİPLİNLERARASI) PROGRAMI**  
**EKONOMİ VE FİNANS (DİSİPLİNLERARASI) YÜKSEK LİSANS PROGRAMI**  
**DERS BİLGİ FORMU**

Dersin Adı	Yatırım Analizi ve Portföy Yönetimi								
Ders Kodu	EFN522			Ders Düzeyi			Yüksek Lisans		
AKTS Kredi	5	İş Yüğü	125 (Saat)	Teori	3	Uygulama	0	Laboratuvar	0
Dersin Amacı	Portföy yönetimi kavramının geleneksel ve modern teoriler ışığında incelenmesi ve portföy yönetimi modelleri uygulamaları ile farklı seçenekler içinden karlı olanın seçilmesine yönelik çalışmaların yapılması ve tartışılması amaçlanmaktadır.								
Özet İçeriği	Temel Kavramlar: Yatırım, hisse senedi, tahvil, bono, fon çeşitleri, özellikleri, portföy, yatırım portföyü, portföy yönetimi								
Staj Durum	Yok								
Öğretim Yöntemleri	Anlatım (Takrir), Bireysel Çalışma								
Dersi Veren Öğretim Elemanı(ları)	Dr. Öğr. Üyesi Şahin BULUT								

#### Ölçme ve Değerlendirme Araçları

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

#### Ders Kitabı / Önerilen Kaynaklar

1	Borsada Uygulamalı Portföy Yönetimi, Prof.Dr.Ali Ceylan
---	---

Hafta	Haftalara Göre Ders Konuları	
1	Teorik	Borsada Uygulamalı Portföy Yönetimi, Prof.Dr.Ali Ceylan
2	Teorik	Şirketler ve yatırımlar için değerlendirme yöntemleri ve uygulamalar
3	Teorik	Risk, risk türleri, risk ölçümü, risk ölçüm yöntemleri,
4	Teorik	Kur, faiz, sermaye ve vadeli işlem ve opsiyon alternatifleri, riskleri ve risk ölçümleri
5	Teorik	Riske Maruz Değer (VaR) kavramı, modelleri, ölçümü, portföy riski ölçümünde kullanımı
6	Teorik	Geleneksel portföy teorisi, modern portföy teorisi, geleneksel ve modern portföy teorileri arasındaki benzer ve farklı yönler
7	Teorik	Markowitz portföy teorisi, karşılaştırmalar
8	Ara Sınav (Vize)	ara sınav
9	Teorik	Finansal varlıkların getirilerinin ve risklerinin, portföy getirisinin ve riskinin ölçümü, getiriler arasındaki hesaplamalar ve uygulamalar
10	Teorik	Bono, hisse senedi getirilerinin hesaplanması
11	Teorik	Sermaye varlıklarını fiyatlama modeli (CAPM) ve uygulamalar
12	Teorik	Arbitraj fiyatlama modeli (APM) ve uygulamalar
13	Teorik	Riskler karşısında portföy yönetimi
14	Teorik	Uluslararası portföy yönetimi
15	Teorik	Genel tekrar ve uygulama



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	14	4	3	98
Ara Sınav	1	10	1	11
Dönem Sonu Sınavı	1	14	2	16
			Toplam İş Yükü (Saat)	125
			Yuvarla [Toplam İş Yükü (saat) / 25*] = <b>AKTS Kredisi</b>	5

\*25 saatlik iş yükü 1 AKTS olarak kabul edilmektedir.

**Dersin Öğrenme Çıktıları**

1	Şirketler ve yatırımlar için değerlendirme yöntemleri ve uygulamalarının incelenmesi
2	Risk, risk türleri, risk ölçümü, risk ölçüm yöntemlerinin kavranması
3	Finansal varlıkların getirilerinin ve risklerinin, portföy getirisinin ve riskinin ölçümü, getiriler arasındaki hesaplamaların yapılması
4	Öğrenciler, olgular arasındaki ilişkileri analitik bir düşünce yapısıyla açıklayabilir.
5	Öğrenciler, derste öğrendikleri teorik bilgileri pratik hayatta tecrübe edebilecektir.

**Program Çıktıları (Ekonomi ve Finans (Disiplinlerarası) Yüksek Lisans Programı)**

1	Ekonomi ve finans alanındaki temel kavramları doğru kullanabilme
2	Ekonomi ve finans alanına etki eden felsefi, sosyal, tarihsel ve psikolojik temelleri kavrayabilme
3	Ekonomik ve finansal olayları teorik ve ampirik olarak analiz edebilme
4	Bir ekonomik veya finansal sorunu bilimsel ilkelere uygun olarak değerlendirebilme
5	Ekonomik ya da finansal bir soruna işbirlikli biçimde, ilke ve ölçütlere uygun çözüm önerileri geliştirebilme
6	Ekonomi ve finans alanlarındaki güncel uygulamaları, ulusal ve uluslararası akademik yayınları izleyebilme
7	Mesleki sorunları/konuları tartışırken ve alanla ilgili çalışmalarını yürütürken ekonomi ve finans alanlarında kullanılan bilimsel yöntem ve etik ilkeleri ön planda tutabilme
8	Ekonomi ve finans alanlarında bilimsel araştırma yapmaya istekli olma
9	Mesleki bir kimlik olarak ekonomi ve finans uzmanlığına değer katabilme

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

	ÖÇ1	ÖÇ2	ÖÇ3	ÖÇ4	ÖÇ5
PÇ1	3	4	4	4	3
PÇ2	3	3	3	5	4
PÇ3	4	4	4	3	5
PÇ4	4	3	3	4	4
PÇ5	4	4	4	5	3
PÇ6	4	4	3	4	4
PÇ7	4	4	4	3	5
PÇ8	4	3	3	4	4
PÇ9	4	4	3	3	3

