



AYDIN ADNAN MENDERES ÜNİVERSİTESİ DERS BİLGİ FORMU

Dersin Adı		Menkul Kıymet Analizi ve Portföy Yönetimi							
Ders Kodu		ISLE403		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 İçeriğı		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							
Dersi Veren Öğretim Elemanı(ları)									

Ölçme ve Değerlendirme Araçları

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

Ders Kitabı / Önerilen Kaynaklar

1	Menkul Değer Yatırımlarına Giriş, Dr. Arman Tevfik ve Dr. Gürman Tevfik, 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 annütelerin 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	Ara Sınav (Vize)	Ara Sınavlar
9	Teorik	Modern Portföy Yaklaşımı
10	Teorik	Geleneksel Portföy Yaklaşımı
11	Teorik	Sermaye Varlıklarını Fiyatlandırma Modeli ve Arbitraj Fiyatlama Modeli
12	Teorik	Teknik Analiz
13	Teorik	Seçilmiş Diğer Değerleme ve Analiz Yöntemleri
14	Teorik	Para piyasası araçları değerlendirme
15	Teorik	Yarıyıl Sonu Sınavına Yönelik Tartışma, Problem Çözme
16	Dönem Sonu Sınavı (Final)	Yarıyıl Sonu Sınavları

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

Etkinlik	Adet	Ön Hazırlık	Etkinlik Süresi	Toplam İş Yüğü
Kuramsal Ders	14	2	3	70
Bireysel Çalışma	7	2	2	28
Ara Sınav	1	10	1	11



Dönem Sonu Sınavı	1	15	1	16
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 sağlamak
2	Menkul kıymetlerin getirisini ve riskini hesaplayabilmek
3	Portföy oluşturarak, portföy riskini ve portföy getirisini hesaplayabilmek
4	Temel analiz ve teknik analiz gerçekleştirebilmek

Program Çıktıları (İşletme Programı)

1	İşletme temel fonksiyonları ve kavramlarını bilmek
2	İşletme alanında edindiği bilgileri çalışma hayatında nasıl uygulayacağını bilmek
3	Uzmanlık alanında gereksinim duyulan bilgiye nasıl ve ne şekilde ulaşılacağını bilmek
4	İktisat, pazarlama, hukuk, finans ve muhasebe gibi alanlarda yeterli bir alt yapı oluşturabilmek.
5	Uluslararası piyasaları takip etmek ve gelişmeleri programda edindiği bilgilerle yorumlayabilmek
6	Çevreyle etkin bir şekilde iletişim kurabilmek
7	Ekip çalışması yapabiliyor olmak
8	Alanında kullanılan bilgisayar yazılımlarını ve iletişim teknolojilerini etkin şekilde kullanmak
9	İşletmecilikle ilgili olası sorunları tanımak ve çözebilmek

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

	ÖÇ1	ÖÇ2	ÖÇ3	ÖÇ4
PÇ1	3	4	2	2
PÇ2	4	3	3	3
PÇ3	3	4	4	4
PÇ4	4	3	3	3
PÇ5	3	2	2	2
PÇ6	4	2	3	5
PÇ7	3	3	2	4
PÇ8	4	4	3	2
PÇ9	3	3	4	3

