



AYDIN ADNAN MENDERES ÜNİVERSİTESİ DERS BİLGİ FORMU

Dersin Adı		Yatırım Analizi ve Portföy Yönetimi							
Ders Kodu		UTIF308		Ders Düzeyi		Lisans			
AKTS Kredi	5	İş Yüğü	126 (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)							
Dersi Veren Öğretim Elemanı(ları)									

Ders Koşulları

AKTS Kredi Koşulu	75
-------------------	----

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	Paranın Zaman Değeri: Gelecek değer ve annütelerin gelecek değeri kavramları, Temel Analiz
2	Teorik	Temel Analiz
3	Teorik	Hisse Senedi Değerlemesi
4	Teorik	Tahvil Değerlemesi
5	Teorik	Menkul Kıymet Analizinde Risk ve Getiri Ölçümü
6	Teorik	Menkul Kıymet Analizinde Risk ve Getiri Hesaplamaları 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	Teorik	Final Sınavı
17	Teorik	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	2	56



Ara Sınav	1	33	1	34
Dönem Sonu Sınavı	1	35	1	36
Toplam İş Yüğü (Saat)				126
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
5	Kâr plânlaması ve Kaldıraç analizlerini öğrenir

Program Çıktıları (Uluslararası Ticaret ve Finans Programı)

1	Entelektüel kapasitesi yüksek, sosyal becerileri gelişmiş, pozitif düşünceye sahip, farklı ortam ve kurumlara adaptasyon becerisi olan bireyler olmak
2	Uluslararası platformlarda çalışabilecek nitelikte teknik donanım, esnek düşünce ve hareket yapısına ve çoklu dil becerisine sahip olmak
3	Küreselleşen iş dünyasının gerekleri doğrultusunda disiplinlerarası bir yaklaşımla işletme, ekonomi vb. alanlarından elde ettikleri temel bilgileri, kendilerine uluslararası ticaret ve finansman alanlarında uzmanlık yaratacak biçimde kullanabilmek
4	Proaktif bir yaklaşımla uluslararası ticaret ve finansman alanlarında bölgesel, ulusal ve uluslararası sorunları öngörüp ilgili kişi ve kurumları bilgilendirerek çözüm önerileri geliştirebilmek
5	Program gereği olarak nicel yeterlik ile birlikte analitik düşünme ve sentez yapabilme becerisine haiz olmak
6	Eğitim sırasında edindiği bilgi ve becerileri, mevcut piyasa koşullarının gereğine uygun olarak sürekli geliştirebilecek araştırmacı ve sorgulayıcı yapıya sahip olmak
7	Uluslararası ticaret ve finansmana ilişkin kuramların günümüz koşullarındaki geçerliliğini ve ilişkilerini tanımlayıp analiz edebilmek
8	Etkin bir iletişim kurabilecek düzeyde İngilizce bilgisine sahip olmanın yanında ikinci bir yabancı dile de bireysel koşulları ölçüsünde hâkim olabilmek
9	Uygulamada karşılaşılan mevcut ve olası sorunları çözmek için yönetme ve yönetilebilme vasıflarına sahip olmak
10	Yetkisi dahilinde yönetici pozisyonunda olduğu birimdeki çalışanların kişisel ve mesleki gelişimine katkıda bulunacak etkinlikleri organize edebilmek

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

	ÖÇ1	ÖÇ2	ÖÇ3	ÖÇ4	ÖÇ5
PÇ1	3	5	4	4	3
PÇ2	2	4	4	3	3
PÇ3	2	4	4	3	3
PÇ4	3	3	4	2	2
PÇ5	3	3	2	2	2
PÇ6	4	2	3	2	3
PÇ7	4	2	3	3	5
PÇ8	4	3	2	3	4
PÇ9	3	5	3	4	4
PÇ10	2	4	3	4	4

