

DERS PROFİLİ

Dersin Adı	Kodu	Yarıyıl	Dönem	Kuram+PÇ+Lab (saat/hafta)	Kredi	AKTS
Portföy Kuramı ve Çözümlemesi	Man 534			3+0+0	3	7

Ön Koşul	Man 504
----------	---------

Dersin Dili	İngilizce
Ders Tipi	Seçmeli
Dersin Okutmanı	
Dersin Asistanı	
Dersin Amaçları	<p>Bu dersin temel amacı bireylerin niçin ve nasıl yatırım kararları verdiği konusunda temel bir altyapı oluşturmaktır. Bu amaca yönelik olarak, portföy teorisi, sermaye piyasası teorisi ve menkul kıymet değerlendirmesi konuları detaylı olarak incelenecektir. Derste ayrıca türev ürünlerine de giriş seviyesinde yer verilecektir. Dersin işleyişi içerisinde bilgisayar kullanımına ağırlıklı olarak önem verilecektir. Bu seçmeli ders bankacılık, aracı kurumlar ve denetleyici kurumlarda portföy yöneticisi yatırım analisti veya stratejist olarak çalışmayı hedefleyen yüksek lisans öğrencilerine hitap etmektedir.</p>
Dersin Öğrenme Çıktıları	<p>Bu dersi başarıyla tamamlayan öğrenciler aşağıdaki becerilere sahip olacaktır:</p> <ol style="list-style-type: none">1. Bilgi toplama ve bilgisayar becerileri <p>Öğrenciler verilen proje çalışmasıyla internet ve bilgisayar kullanımı becerilerine sahip olacaktır. Proje için internet üzerinden veri toplanması, bu verinin Excel kullanılarak düzenlenmesi, analiz edilmesi ve sunuma hazır hale getirilmesi gerekmektedir.</p> <ol style="list-style-type: none">2. Alana özgü bilgi ve tecrübe edinimi <p>Öğrenciler disipline has aşağıdaki kavramlar ile ilgili altyapıya sahip olacaktır: Yatırım araçlarının özellikleri ve kullanma alanları, yatırım riskini türleri, yatırım getirisinin farklı ölçekleri, tahvil ve hisse senedi değerlemesi,yatırım teorisi, portföy oluşturulması ve analizi,</p>

	<p>yatırım stratejileri, portföy çeşitlendirmesi ve varlık fiyatlandırma modelleri.</p> <p>3. Değer yaratılması Öğrencilerin gelecekte kariyerlerinde karşılaşacakları yatırım yapmak isteyen müşterilerine ihtiyaçlarına uygun portföy oluşturmalarında yatırım değerlendirme, risk analizi ve portföy teorisi kavramlarını kullanarak yardımcı olabilme becerisine sahip olmaları.</p> <p>4. Yazılı iletişim Yazılı basında çıkan uzmanların yorumlarını analiz eden ödevler ile öğrencilerin iletişim becerileri artırılacaktır.</p>
Dersin İçeriği	

DERS İÇERİĞİ

Hafta	Konu	İlişigi
1	Giriş	
2	Risk ve Getiri Kavramları	
3	Portföy Kuramı	
4	Sermaye Varlıklarını Fiyatlandırma Modeli	
5	Arbitraj Fiyatlama Teorisi	
6	Faktör Modelleri	
7	Sabit Getirili Menkul Kıymetler	
8	Tahvil Analizi	
9	Tahvil Portföyü Yönetimi	
10	Hisse Senetlerinin Değerlemesi	
11	Piyasa Etkinliği	
12	Portföy Performansının Ölçülmesi	
13	Vadeli İşlem Sözleşmeleri	
14	Opsiyon Sözleşmeleri	

Ders Kitabı	Elton, E. J., M. J. Gruber, S. J. Brown and W. N. Goetzmann, Modern Portfolio Theory and Investment Analysis, Wiley, 7th Edition, 2006.
Önerilen Kaynaklar	

Yarıyıl Gereksinimleri	Sayı	Not Yüzdesi
Devam/Katılım		
Laboratuvar		
Uygulama		
Staj		
Kısa Sınav		
Ödevler	2	10
Sunum		
Proje	1	20
Seminer		
Ara sınav	2	40
Final	1	30
Toplam		100

Yarıyıl Çalışmalarının Yüzdesi		70
Final Yüzdesi		30
Toplam		100

DERS ÇIKTILARININ PROGRAM ÇIKTILARINA KATKISI

#	Program Çıktıları	Katkı Düzeyi *				
		1	2	3	4	5
1		X				
2						X
3					X	
4				X		
5			X			
6			X			
7				X		
8					X	

*1 En az, 2 Az, 3 Ortalama, 4 Yüksek, 5 En yüksek

ÖĞRENCİ İŞ YÜKÜ /AKTS (AVRUPA KREDİ TRANSFER SİSTEMİ) TABLOSU

Etkinlikler	Sayı	Süre (Saat)	Toplam İşyükü
Ders Saati (Sınavlar Dahil)	15	3	45
Öğreticiler			
Laboratovar			
Uygulama	10	4	40
Staj			
Saha Araştırması			
Ders Saatleri Dışı Çalışma	10	3	30
Sunum / Seminer			
Proje			
Ders Öncesi Okuması	10	3	30
Ödevler	1	10	10
Kısa Sınavlar			
Ara Sınavlar	1	10	10
Final Sınavı	1	10	10
Toplam İş Yükü			175

DERS KATEGORİLERİ

ISCED GENEL ALAN KODU	GENEL ALANLAR	ISCED TEMEL ALAN KODU	EĞİTİM VE ÖĞRETİM TEMEL ALANLARI	
1	Eğitim	14	Öğretmen Yetiştirme ve Eğitim Bilimi	0
2	Beşeri Bilimler ve Sanat	21	Sanat	0
		22	Beşeri Bilimler	0
3	Sosyal Bilimler, İşletme ve Hukuk	31	Sosyal ve Davranış Bilimleri	0
		32	Gazetecilik ve Enformasyon	0
		34	İşletme ve Yönetim Bilimleri	100
		38	Hukuk	0
4	Bilim, Matematik ve Bilgisayar	42	Yaşam Bilimleri	0
		44	Doğa Bilimleri	0
		46	Matematik ve İstatistik	0
		48	Bilgisayar	0
5	Mühendislik, Üretim ve Yapı	52	Mühendislik	0
		54	Üretim ve İşleme	0
		58	Mimarlık ve Yapı	0
6	Tarım ve Veterinerlik	62	Tarım, Ormancılık ve Su Ürünleri	0
		64	Veterinerlik	0
7	Sağlık ve Refah	72	Sağlık	0
		76	Sosyal Hizmetler	0
8	Hizmetler	81	Kişisel Hizmetler	0
		84	Ulaştırma Hizmetleri	0

		85	Çevre Koruma	0
		86	Güvenlik Hizmetleri	0