

DERS PROFİLİ

Dersin Adı	Kodu	Yarıyıl	Dönem	Kuram+PÇ+Lab (saat/hafta)	Kredi	AKTS
Yatırım Değerleme ve Analiz	Man 538		Bahar	3	3	7

Ön Koşul	Yok
----------	-----

Dersin Dili	İngilizce
Ders Tipi	Seçmeli
Dersin Okutmanı	
Dersin Asistanı	
Dersin Amaçları	Teorik yöntemler aracılığı ile menkul kıymet seçimi, portföy yönetilmesi ve yatırım değerlendirilmesi konularında bilgi sahibi olmalarının sağlanması hedeflenmektedir.
Dersin Öğrenme Çıktıları	<p>Portföy oluştururken kullanılacak değişik finansal varlıkların risk ve getiri özelliklerini tasvir edebilmek ve bu finansal varlıkların nerede ve nasıl alınıp satılabileceğini ifade edebilmek.</p> <p>Modern portföy teorisinin temel prensiplerini ve bunların yatırımcı davranışını ne şekilde etkilediğini yorumlayabilmek ve bu bağlamda bir birey için uygun yatırım portföyü oluşturabilmek.</p> <p>Etkin piyasalar hipotezinin portföy yönetimi üzerindeki yansımalarını yorumlayabilmek</p> <p>Farklı hisse senedi seçim tekniklerinin portföy oluştururken kullanabilmek</p> <p>Aktif tahvil portföyü yönetim tekniklerini anlayıp kullanabilmek.</p> <p>Türev enstrümanları kullanarak riskten kaçınmak</p> <p>Geçmiş verilere bakarak yönetilen portföylerin performansını ölçebilmek</p>

Dersin İeriđi	Görece deđerleme; piyasa arpanları; enflasyonun piyasa arpanları üzerine etkisi; indirgenmiş nakit akımları analizi; varlık yaklaşımı; ađırlıklı ortalama sermaye maliyeti yöntemi; ayarlanmış şimdiki deđer yöntemi; özkaynak yaklaşımı; opsiyon fiyatlama uygulamaları.
-----------------------	---

DERS İERİĐİ

Hafta	Konu	İlişđi
1	Yatırım Analizine Giriş	Zvi Bodie, Alex Kane, Alan J. Marcus, "Essentials of Investments", McGrawHill
2	Sermaye Piyasası Araları	Zvi Bodie, Alex Kane, Alan J. Marcus, "Essentials of Investments", McGrawHill
3	Menkul kıymet Piyasaları Halka Arz	Zvi Bodie, Alex Kane, Alan J. Marcus, "Essentials of Investments", McGrawHill
4	Finansal Varlık Fiyatlandırma Modeli ve Arbitraj Fiyatlandırma Modeli	Zvi Bodie, Alex Kane, Alan J. Marcus, "Essentials of Investments", McGrawHill
5	Finansal Varlıklarda Risk ve Getiri Kavramları	Zvi Bodie, Alex Kane, Alan J. Marcus, "Essentials of Investments", McGrawHill
6	Risk ve Getiri Analizi, Risk primi Varlık eşitlendirmesi Faiz oranları	Zvi Bodie, Alex Kane, Alan J. Marcus, "Essentials of Investments", McGrawHill
7	Ara Sınav	
8	Etkin Varlık eşitlendirme	Zvi Bodie, Alex Kane, Alan J. Marcus, "Essentials of Investments", McGrawHill
9	Tahvil Portföylerinin Yönetimi	Zvi Bodie, Alex Kane, Alan J. Marcus, "Essentials of Investments", McGrawHill
10	Hisse Senedi Deđerlemesi	Zvi Bodie, Alex Kane, Alan J. Marcus, "Essentials of Investments", McGrawHill
11	Opsiyon Deđerlemesi	Zvi Bodie, Alex Kane, Alan J. Marcus, "Essentials of Investments", McGrawHill
12	Etkin Piyasalar Varsayımı	Zvi Bodie, Alex Kane, Alan J. Marcus, "Essentials of Investments", McGrawHill
13	Gelecek Sözleşmeleri Piyasaları ve Risk Yönetimi	Zvi Bodie, Alex Kane, Alan J. Marcus, "Essentials of Investments", McGrawHill
14	Gözden Geçirme	

Ders Kitabı	Zvi Bodie, Alex Kane, Alan J. Marcus, "Essentials of Investments", McGrawHill – 8. Basım, Eighth Edition,
Önerilen Kaynaklar	

Yarıyıl Gereksinimleri	Sayı	Not Yüzdesi
Devam/Katılım	1	10
Laboratuvar		
Uygulama		
Staj		
Kısa Sınav		
Ödevler		
Sunum	1	5
Proje	1	15
Seminer		
Ara sınav	1	30
Final	1	40
Toplam	5	100

Yarıyıl Çalışmalarının Yüzdesi		60
Final Yüzdesi		40
Toplam		100

DERS ÇIKTILARININ PROGRAM ÇIKTILARINA KATKISI

#	Program Çıktıları	Katkı Düzeyi *				
		1	2	3	4	5
1	Portföy oluştururken kullanılabilir deęişik finansal varlıkların risk ve getiri özelliklerini tasvir edebilmek ve bu finansal varlıkların nerede ve nasıl alınıp satılabileceğini ifade edebilmek.					X
2	Modern portföy teorisinin temel prensiplerini ve bunların yatırımcı davranışını ne şekilde etkilendiğini yorumlayabilmek ve bu bağlamda bir birey için uygun yatırım portföyü oluşturabilmek.					X
3	Etkin piyasalar hipotezinin portföy yönetimi üzerindeki yansımalarını yorumlayabilmek					X
4	Farklı hisse senedi seçim tekniklerinin portföy oluştururken kullanabilmek					X
5	Aktif tahvil portföyü yönetim tekniklerini anlayıp kullanabilmek.					X
6	Türev enstrümanları kullanarak riskten kaçınmak					X
7	Geçmiş verilere bakarak yönetilen portföylerin performansını ölçebilmek					X
8						

*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)	14	3	42
Öğreticiler			
Laboratovar			
Uygulama			
Staj			
Saha Araştırması			
Ders Saatleri Dışı Çalışma	14	6	84
Sunum / Seminer	1	3	3
Proje	1	20	20
Ders Öncesi Okuması			
Ödevler			
Kısa Sanavlar			
Ara Sınavlar	1	13	13
Final Sınavı	1	13	13
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