

<b>DERS BİLGİLERİ FORMU</b>	
<b>Dersi Açan Fakülte/ Enstitü</b>	Sosyal Bilimler Enstitüsü
<b>Dersi Açan Bölüm/ Ana Bilim Dalı</b>	İşletme
<b>Dersin Kodu</b>	İŞL 566
<b>Dersin Adı</b>	Portföy Analizi ve Yönetimi
<b>Öğretim Dili</b>	Türkçe
<b>Dersi Alan Programlar</b>	İşletme Tezli/Tezsiz Yüksek Lisans
<b>Ders Türü</b>	Seçmeli Ders
<b>Dersin Seviyesi</b>	Yüksek Lisans
<b>AKTS Kredisi</b>	9
<b>Ön Koşullar</b>	Yok
<b>Dersin İçeriği</b>	Yatırım kavramı, yatırım alternatifleri, yatırım şirketleri, menkul kıymet piyasaları, getiri ve risk, tahvil ve değerlemesi, hisse senedi değerlemesi, ekonomi ve sektör analizi, temel ve teknik analiz, opsiyon, futures ve forward sözleşmeler, portföy seçimi, sermaye piyasası teorisi, portföy yönetimi.
<b>Dersin Amacı</b>	Bu dersin amacı yatırım analizi ve portföy yönetimi dersinin temel konuları olan yatırım kavramı, yatırım alternatifleri, yatırım şirketleri, menkul kıymet piyasaları, getiri ve risk, tahvil ve değerlemesi, hisse senedi değerlemesi, ekonomi ve sektör analizi, temel ve teknik analiz, opsiyon, futures ve forward sözleşmeler, portföy seçimi, sermaye piyasası teorisi, portföy yönetimi öğrencilere sunmak ve bu konular hakkında temel bilgilere sahip olmalarını sağlamaktır.
<b>Dersin Kazanımları</b>	Bu dersin sonunda öğrenciler; 1) Ticaret yapabilecekleri piyasaları ve bu piyasalardaki ürünleri tanırlar 2) Yatırıma ilişkin temel mevzuatı bilir, bu alandaki etik ve profesyonel davranış şekillerine hakimdir 3) Etkin piyasalar hipotezini ve bu hipoteze ilişkin karşıt ve uyumlu görüşleri anlatabilir 4) Portföy yönetimindeki çeşitlendirme ve etkin set gibi önemli kavramları bilir 5) Sermaye varlıklarını fiyatlandırma modeli ve arbitraj fiyatlama modeli gibi risk ve getiri arasında ilişki kuran modelleri açıklayabilir 6) Tahvilleri ve hisse senetlerini iskonto edilmiş nakit akışı yöntemi ve diğer yöntemleri kullanarak değerleyebilir 7) Tahvil ve hisse senedi portföylerinin temel yönetim tekniklerini ve prensiplerini uygulayabilir 8) Farklı portföy performans ölçüm yöntemlerini kullanabilir 9) Futures ve opsiyon gibi türev ürünlerin genel özelliklerini bilir
<b>Ders Kitabı ve/veya Kaynaklar</b>	Alexander, G.J., Sharpe W.F., Bailey J.V., (2001). Fundamentals of Investments. 3. Edition, Prentice Hall.
<b>Değerlendirme Ölçütleri</b>	<b>Katkı payı</b>
<b>Devam</b>	15%
<b>Laboratuvar</b>	
<b>Uygulama</b>	
<b>Alan Çalışması</b>	
<b>Ödev</b>	
<b>Sunum</b>	
<b>Projeler</b>	
<b>Seminer</b>	
<b>Ara Sınavlar</b>	35%
<b>Quiz</b>	
<b>Final</b>	50%
<b>Toplam</b>	100%
<b>Ders Planı</b>	<b>Tartışılacak/ İşlenecek Konular</b>
<b>1. Hafta</b>	Derse Giriş
<b>2. Hafta</b>	Menkul Kıymetlerin Alım Satımı
<b>3. Hafta</b>	Menkul Kıymet Piyasaları
<b>4. Hafta</b>	Etkin Piyasalar
<b>5. Hafta</b>	Portföy Analizi
<b>6. Hafta</b>	Sermaye Varlıkları Fiyatlama Modeli
<b>7. Hafta</b>	Faktör Modelleri
<b>8. Hafta</b>	Ara Sınav
<b>9. Hafta</b>	Arbitraj Fiyatlama Modeli
<b>10. Hafta</b>	Tahvil Değerlemenin Temelleri

<b>11. Hafta</b>	Tahvil Analizi
<b>12. Hafta</b>	Opsiyonlar ve Vadeli İşlem Sözleşmeleri