

Dersin Tanımı					
Adı	Kodu	Yarıyıl	T+U Saat	Kredi	AKTS
YATIRIM ANALİZİ VE PORTFÖY YÖNETİMİ	ITF4171620	Güz Dönemi	3+0	3	5
Ön Koşul Dersleri					
Önerilen Seçmeli Dersler					
Dersin Dili	İngilizce				
Dersin Seviyesi	Lisans				
Dersin Türü	Programa Bağlı Seçmeli				
Dersin Koordinatörü	Prof.Dr. Serhat YÜKSEL				
Dersi Verenler	Prof.Dr. Serhat YÜKSEL				
Dersin Yardımcıları	-				
Dersin Amacı	Mali yatırımların önemlilerinden olan hisse senetlerinin değerlendirilmesi için kullanılan araçlar ve yaklaşımlar hakkında ve portföy yönetiminin kuramsal temelleri hakkında bilgi sahibi olmaktır.				
Dersin İçeriği	Bu ders; Getiri kavramları,Risk ve risk primi kavramları,Çeşitlendirme,En iyi portföyü kurma,Sermaye Varlığı Fiyatlama Kuramı,Arbitraj Fiyatlama Kuramı,Etkin Piyasa Hipotezi,Davranışsal finans,Teknik analiz,Makroekonomik analiz,Sektör analizi,Hisse senedi değerlendirme ,Mali tablolar,Mali oranlar; konularını içermektedir.				
Dersin Öğrenme Kazanımları	Öğretim Yöntemleri	Ölçme Yöntemleri			
1. Risk ve getiri kavramları hakkında hesaplamalar yapabilecektir.	10, 9	A			
1.1. Çeşitli getiri kavramlarını kullanır.	10, 9				
1.2. Portföy riskinin sayısal bir tanımını yapar.	10, 9				
2. Modern portföy kuramının temel kavramlarını uygulayabilecektir.	10, 9	A			
2.1. Çeşitlendirmenin riski azaltmadaki önemini örneklerle gösterir.	10, 9				
2.2. Tek riskli varlık ve risksiz bir varlıkla en iyi portföyü kurma hesabını kullanır.	10, 9				
3. Sermaye Varlığı Fiyatlama Kuramını kullanabilecektir.	10, 9	A			
3.1. Sermaye Varlığı Fiyatlama Kuramının sonucu olan eşitliği kullanır.	10, 9				
3.2. Başka yollarla elde edilebilecek beklenen getiri oranı bilgisini, Sermaye Varlığı Fiyatlama Kuramından elde edilen getiri oranı ile karşılaştırır.	10, 9				
4. Etkin Piyasa Hipotezinin kuramsal altyapısını kullanabilecektir.	10, 9	A			
4.1. Etkin Piyasa Hipotezinin üç değişik formunu ifade eder.	10, 9				
4.2. Verilebilecek çeşitli senaryolarda Etkin Piyasa Hipotezinin hangi formlarının işlerlik halinde olduğunu açıklar.	10, 9				
5. Davranışsal finansın temel yaklaşımını ve teknik analiz ne olduğunu açıklayabilecektir.	10, 9	A			
5.1. Davranışsal finans çalışmalarında klasik iktisat görüşüne yöneltilen eleştirileri açıklar.	10, 9				
5.2. Teknik analiz genel yaklaşımını ve bazı örnekleri açıklar.	10, 9				
Öğretim Yöntemleri	10: Tartışma Yöntemi, 9: Anlatım Yöntemi				
Ölçme Yöntemleri	A: Klasik Yazılı Sınav				
Ders Akışı					
Sıra	Konular	Ön Hazırlık			
1	Getiri kavramları				
2	Risk ve risk primi kavramları				
3	Çeşitlendirme				
4	En iyi portföyü kurma				
5	Sermaye Varlığı Fiyatlama Kuramı				
6	Arbitraj Fiyatlama Kuramı				
7	Etkin Piyasa Hipotezi				
8	Davranışsal finans				
9	Teknik analiz				
10	Makroekonomik analiz				
11	Sektör analizi				
12	Hisse senedi değerlendirme				
13	Mali tablolar				
14	Mali oranlar				
Değerlendirme Yöntemleri	Sınava Katkısı				
Ara Sınav	40				
Genel Sınav	60				

Kaynaklar	
1. Bodie, Kane ve Marcus, Essentials of Investments, McGraw-Hill (2023)	
Ek Okumalar	
1. Sharpe, Alexander ve Bailey, Investments, Prentice Hall (2023)	
2. Weston, Besley, Brigham. (2022) Essentials of Managerial Finance. Dryden	