

İşletme ve Yönetim Bilimleri Fakültesi / İşletme Programı (İngilizce)

2021 - 2022 Eğitim Öğretim Yılı

YATIRIM ANALİZİ VE PORTFÖY YÖNETİMİ

Ders Tasarımı (Syllabus)

| Dersin Tanımı | | | | | |
|---|---|-------------------------|----------|-------|------|
| Adı | Kodu | Yarıyıl | T+U Saat | Kredi | AKTS |
| YATIRIM ANALİZİ VE PORTFÖY YÖNETİMİ | BUS3171620 | 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. Hatice KARAHAN | | | | |
| Dersi Verenler | Dr.Öğr.Üye. Bilal BAĞIŞ | | | | |
| 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 Çıktıları | Öğretim Yöntemleri | Ölçme Yöntemleri | | | |
| 1. Risk ve getiri kavramları hakkında hesaplamalar yapabilecektir. | 1, 3 | A, C | | | |
| 1.1. Çeşitli getiri kavramlarını kullanır. | 1, 3 | | | | |
| 1.2. Portföy riskinin sayısal bir tanımını yapar. | 1, 3 | | | | |
| 1.3. Servetin çeşitli yatırım araçları arasında nasıl paylaştırılacağına dair bir kuramı ifade eder. | 1, 3 | | | | |
| 2. Modern portföy kuramının temel kavramlarını uygulayabilecektir. | 1, 3 | A, C | | | |
| 2.1. Çeşitlendirmenin riski azaltmadaki önemini örneklerle gösterir. | 1, 3 | | | | |
| 2.2. Tek riskli varlık ve risksiz bir varlıkla en iyi portföyü kurma hesabını öğrenir. | 1, 3 | | | | |
| 2.3. Birden çok riskli varlık ve risksiz bir varlıkla en iyi portföyü kurma hesabını öğrenir. | 1, 3 | | | | |
| 3. Sermaye Varlığı Fiyatlama Kuramını kullanabilecektir. | 1, 3 | A, C | | | |
| 3.1. Sermaye Varlığı Fiyatlama Kuramının sonucu olan eşitliği kullanır. | 1, 3 | | | | |
| 3.2. Başka yollarla elde edilebilecek beklenen getiri oranı bilgisini, Sermaye Varlığı Fiyatlama Kuramından elde edilen getiri oranı ile karşılaştırır. | 1, 3 | | | | |
| 3.3. Arbitraj Fiyatlama Kuramının mantığını ifade eder. | 1, 3 | | | | |
| 4. Etkin Piyasa Hipotezinin kuramsal altyapısını kullanabilecektir. | 1, 3 | A, C | | | |
| 4.1. Etkin Piyasa Hipotezinin üç değişik formunu ifade eder. | 1, 3 | | | | |
| 4.2. Verilebilecek çeşitli senaryolarda Etkin Piyasa Hipotezinin hangi formlarının işlerlik halinde olduğunu açıklar. | 1, 3 | | | | |
| 4.3. Etkin piyasa hipotezinin hangi formlarının hangi piyasalarda geçerli olduğu hakkında bilgi edinir. | 1, 3 | | | | |
| 5. Davranışsal finansın temel yaklaşımını ve teknik analiz ne olduğunu açıklayabilecektir. | 1, 3 | A, C | | | |
| 5.1. Davranışsal finans çalışmalarında klasik iktisat görüşüne yöneltilen eleştirileri açıklar. | 1, 3 | | | | |
| 5.2. Teknik analizin genel yaklaşımını ve bazı örnekleri açıklar. | 1, 3 | | | | |
| 6. Makroekonomik analiz ve sektör analizinin temel ilkelerini açıklayabilecektir. | 1, 3 | A, C | | | |
| 6.1. Yerli ve küresel ekonomileri etkileyen temel değişkenleri açıklar. | 1, 3 | | | | |
| 6.2. Temel ekonomik göstergeleri açıklar. | 1, 3 | | | | |
| 6.3. Sektör analizinin temel ilkelerini açıklar. | 1, 3 | | | | |
| 7. Hisse senedi değerlendirme ile ilgili temel yaklaşımları kullanabilecektir. | 1, 3 | A, C | | | |
| 7.1. Kar payı iskonto modellerini kullanarak hisse senedi değeri belirlemeyi açıklar. | 1, 3 | | | | |
| 7.2. Fiyat-kazanç oranları ile hisse senedi değeri belirlemeyi açıklar. | 1, 3 | | | | |
| 7.3. Serbest nakit akışı yaklaşımını açıklar. | 1, 3 | | | | |
| 8. Mali tablo analizinin temel ilkelerini açıklayabilecektir. | 1, 3 | A, C | | | |
| 8.1. Temel mali tabloların anlamlarını açıklar. | 1, 3 | | | | |
| 8.2. Mali oranlardan önemli olan bazılarının işaret ettiği noktalar üzerinden mali tablo analizi yapma becerisi geliştirir. | 1, 3 | | | | |
| 8.3. Özsermaye getiri oranının önemli bir çözümlenmesini açıklar. | 1, 3 | | | | |
| Öğretim Yöntemleri | 1: Anlatım, 3: Tartışma | | | | |
| Ölçme Yöntemleri | A: Yazılı sınav, C: Ödev | | | | |
| 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 | | | | |

İşletme ve Yönetim Bilimleri Fakültesi / İşletme Programı (İngilizce)
2021 - 2022 Eğitim Öğretim Yılı
YATIRIM ANALİZİ VE PORTFÖY YÖNETİMİ
Ders Tasarımı (Syllabus)

| Ders Akışı | | |
|--|----------------|--------------------|
| Sıra | Konular | Ön Hazırlık |
| 14 | Mali oranlar | |
| Kaynaklar | | |
| Bodie, Kane ve Marcus, Essentials of Investments, McGraw-HillSharpe, Alexander ve Bailey, Investments, Prentice Hall | | |