

Dersin Tanımı					
Adı	Kodu	Yarıyıl	T+U Saat	Kredi	AKTS
YATIRIM ANALİZİ VE PORTFÖY YÖNETİMİ	FİBD1143770	Güz Dönemi	3+0	3	8
Ön Koşul Dersleri					
Önerilen Seçmeli Dersler					
Dersin Dili	Türkçe				
Dersin Seviyesi	Doktora				
Dersin Türü	Zorunlu				
Dersin Koordinatörü	Dr.Öğr.Üye. Ali Osman Serdar ÇITAK				
Dersi Verenler	Dr.Öğr.Üye. Ali Osman Serdar ÇITAK				
Dersin Yardımcıları					
Dersin Amacı	Öğrencilere, yatırım ve portföy yönetimi konularında güncel teorik ve uygulamalı bilgilerin verilmesi amaçlanmaktadır.				
Dersin İçeriği	Bu ders; 1.Finansal piyasalar,2.Finansal kurumlar,3.Finansal araçlar,4.Paranın Zaman Değeri,5.Finansal tablolar,6.Finansal analiz,7.Temel analiz,8.Hisse senedi değerlemesi,9.Tahvil değerlemesi,10.Portföy, risk ve getiri,11.Portföy Yönetimi,12.Teknik analiz,13.Vadeli işlem piyasaları,14.Türev ürün çeşitleri; konularını içermektedir.				
Dersin Öğrenme Çıktıları	Öğretim Yöntemleri	Ölçme Yöntemleri			
Bu dersin sonunda öğrenci;	1, 2, 3	A, C			
1.Finansal piyasalara ilişkin kavramları tanımlayabilecektir.	1, 2, 3	A, C			
1.1.Finansal piyasaları tanımlar.	1, 2, 3	A, C			
1.2.Finansal piyasaları sınıflandırır.	1, 2, 3	A, C			
1.3.Gelişmiş ülkelerdeki finansal piyasaları karşılaştırır.	1, 2, 3	A, C			
1.4.Gelişmekte ülkelerdeki finansal piyasaları karşılaştırır.	1, 2, 3	A, C			
2.Finansal kurumlar ve araçların özelliklerini değerlendirebilecektir.	1, 2, 3	A, C			
2.1.Finansal aracı kurumları tanımlar.	1, 2, 3	A, C			
2.2.Finansal araçların özelliklerini karşılaştırır.	1, 2, 3	A, C			
2.3.Finansal piyasalarda hukuki ve idari yapıyı tanımlar.	1, 2, 3	A, C			
2.4.Menkul kıymet borsalarını açıklar.	1, 2, 3	A, C			
3.Paranın zaman değerini uygulayabilecektir.	1, 2, 3	A, C			
3.1.Nominal ve reel faiz kavramlarını karşılaştırır.	1, 2, 3	A, C			
3.2.Basit faiz kavramını açıklar.	1, 2, 3	A, C			
3.3.Bileşik faiz kavramını açıklar.	1, 2, 3	A, C			
3.4.Anüite kavramını açıklar.	1, 2, 3	A, C			
4.Finansal tablolar analizini uygulayabilecektir.	1, 2, 3	A, C			
4.1.Finansal tabloları tanımlar.	1, 2, 3	A, C			
4.2.Finansal tabloların özelliklerini karşılaştırır.	1, 2, 3	A, C			
4.3.Finansal analiz türlerini açıklar.	1, 2, 3	A, C			
4.4.Finansal analizlere ilişkin örnekleri uygular.	1, 2, 3	A, C			
4.5.Temel analiz yöntemini uygular.	1, 2, 3	A, C			
5.Hisse senedi değerlemesini uygulayabilecektir.	1, 2, 3	A, C			
5.1.Hisse senedine ilişkin temel kavramları tanımlar.	1, 2, 3	A, C			
5.2.Değerleme kavramını tanımlar.	1, 2, 3	A, C			
5.3.Hisse senedi değerlendirme yaklaşımlarını karşılaştırır.	1, 2, 3	A, C			
6.Tahvil ve diğer sabit getirili menkul kıymet değerlemesini uygulayabilecektir.	1, 2, 3	A, C			
6.1.Tahvile ilişkin temel kavramları tanımlar.	1, 2, 3	A, C			
6.2.Diğer sabit getirili menkul kıymetlere ilişkin temel kavramları tanımlar.	1, 2, 3	A, C			
6.3.Sabit getirili menkul kıymet değerlendirme yaklaşımlarını karşılaştırır.	1, 2, 3	A, C			
7.1.Portföy, risk ve getiri kavramlarını açıklar.	1, 2, 3	A, C			
7.2.Etkin sınır ve portföy seçimini uygular.	1, 2, 3	A, C			
7.3.Portföy yönetimine ilişkin yaklaşımları açıklar.	1, 2, 3	A, C			
7.4.Portföy yönetim stratejilerini karşılaştırır.	1, 2, 3	A, C			
7.5.Portföy performansını ölçer.	1, 2, 3	A, C			
8.Teknik Analizi uygulayabilecektir.	1, 2, 3	A, C			
8.1.Teknik analizi kavramını açıklar.	1, 2, 3	A, C			
8.2.Teknik analize ilişkin göstergeleri tanımlar.	1, 2, 3	A, C			
8.3.Teknik analiz verilerini değerlendirir.	1, 2, 3	A, C			
9.Vadeli işlem piyasalarını değerlendirebilecektir.	1, 2, 3	A, C			
9.1.Vadeli işlem sözleşmelerini açıklar.	1, 2, 3	A, C			
9.2.Forward sözleşmelerini açıklar.	1, 2, 3	A, C			
9.3.Opsiyon sözleşmelerini açıklar.	1, 2, 3	A, C			
9.4.Türev ürünleri değerler.	1, 2, 3	A, C			
7. Portföy yönetimine ilişkin temel kavramları değerlendirebilecektir.	1, 2, 3	A, C			
Öğretim Yöntemleri	1: Anlatım, 2: Soru - Cevap, 3: Tartışma				
Ölçme Yöntemleri	A: Yazılı sınav, C: Ödev				
Ders Akışı					
Sıra	Konular	Ön Hazırlık			

Sosyal Bilimler Enstitüsü / Bankacılık ve Finans Doktora Programı
2021 - 2022 Eğitim Öğretim Yılı
YATIRIM ANALİZİ VE PORTFÖY YÖNETİMİ
Ders Tasarımı (Syllabus)

Ders Akışı		
Sıra	Konular	Ön Hazırlık
1	1.Finansal piyasalar	
2	2.Finansal kurumlar	
3	3.Finansal araçlar	
4	4.Paranın Zaman Değeri	
5	5.Finansal tablolar	
6	6.Finansal analiz	
7	7.Temel analiz	
8	8.Hisse senedi değerlemesi	
9	9.Tahvil değerlemesi	
10	10.Portföy, risk ve getiri	
11	11.Portföy Yönetimi	
12	12.Teknik analiz	
13	13.Vadeli işlem piyasaları	
14	14.Türev ürün çeşitleri	

Kaynaklar

Dersin notları1.Mehmet Baha Karan, Yatırım Analizi ve Portföy Yönetimi
2.Edwin J. Elton, Martin J. Gruber, Stephen J. Brown, William N. Goetzmann, Modern Portfolio Theory and Investment Analysis
3.Frank K. Reilly, Keith C. Brown, Investment Analysis and Portfolio Management