

Dersin Tanımı					
Adı	Kodu	Yarıyıl	T+U Saat	Kredi	AKTS
YATIRIM ANALİZİ VE PORTFÖY YÖNETİMİ	BAN4154050	Güz Dönemi	3+0	3	5
<b>Ön Koşul Dersleri</b>					
<b>Önerilen Seçmeli Dersler</b>					
<b>Dersin Dili</b>	Türkçe				
<b>Dersin Seviyesi</b>	Lisans				
<b>Dersin Türü</b>	Zorunlu				
<b>Dersin Koordinatörü</b>	Dr.Öğr.Üye. Ali Osman Serdar ÇITAK				
<b>Dersi Verenler</b>	Prof.Dr. Hasan DİNÇER				
<b>Dersin Yardımcıları</b>					
<b>Dersin Amacı</b>	Yatırım analizi ve portföy yönetimi için gerekli teorik çerçeveyi, araçları ve pratik konuları sunmaktır.				
<b>Dersin İçeriği</b>	Bu ders; Yatırımın Temel Kavramları, Finansal Yatırım ve Portföy Kavramı, Finansal Risk Yönetimi, Yatırımcı Fayda Fonksiyonu, Portföy Yönetimine Giriş, Portföy Yönetimi Kuramları, Geleneksel Yaklaşım, Ortalama-Varyans Yaklaşımı, Faktör Modelleri Yaklaşımı, Portföy Performansının Ölçülmesi, Vadeli Piyasalarda Portföy Yönetimi, Portföy Yönetimi Faaliyetlerinin Uygulamada Tanıtılması, Portföy Yönetim Şirketlerinin Uygulamada Tanıtılması, Uluslararası Piyasalar ve Portföy Yönetimi; konularını içermektedir.				
<b>Dersin Öğrenme Çıktıları</b>				<b>Öğretim Yöntemleri</b>	<b>Ölçme Yöntemleri</b>
1. Yatırımın temel kavramlarını analiz edebilecektir.				1, 2, 3, 4	A, B, C
1.1. Temel kavramları tanımlar.				1, 2, 3, 4	A, B, C
1.2. Kavramları gerçek hayatla ilişkilendirir.				1, 2, 3, 4	A, B, C
2. Finansal risk yönetimi sürecini anlayabilecektir.				1, 2, 3, 4	A, B, C
2.1. Finansal risk yönetimi sürecini tanımlar.				1, 2, 3, 4	A, B, C
2.2. Risk yönetimini değerlendirebilir.				1, 2, 3, 4	A, B, C
3. Portföy yönetiminin temel kavramlarını analiz edebilecektir.				1, 2, 3, 4	A, B, C
3.1. Portföy yönetimi temel kavramlarını tanımlar.				1, 2, 3, 4	A, B, C
3.2. Portföy yönetimi temel kavramlarını değerlendirir.				1, 2, 3, 4	A, B, C
4. Hisse senedi ve sabit getirili finansal araçları analiz edebilecektir.				1, 2, 3, 4	A, B, C
4.1. Temel kavramları tanımlar.				1, 2, 3, 4	A, B, C
4.2. Hisse senedi ve sabit getirili finansal araçları çözümler.				1, 2, 3, 4	A, B, C
5. Yatırım kararlarını ve yönetim sürecini analiz edebilecektir.				1, 2, 3, 4	A, B, C
5.1. Yatırım kararlarını değerlendirebilir.				1, 2, 3, 4	A, B, C
5.2. Yatırım yönetim sürecini değerlendirebilir.				1, 2, 3, 4	A, B, C
6. Portföy yönetim tekniklerini analiz edebilecektir.				1, 12, 2, 3, 4	A, B, C
6.1. Temel kavramları tanımlar.				1, 12, 2, 3, 4	A, B, C
6.2. Portföy yönetim tekniklerini değerlendirebilir.				1, 12, 2, 3, 4	A, B, C
7. Portföy performans tekniklerini analiz edebilecektir.				1, 12, 2, 3, 4	A, B, C
7.1. Temel kavramları tanımlar.				1, 12, 2, 3, 4	A, B, C
7.2. Portföy performans tekniklerini değerlendirir.				1, 12, 2, 3, 4	A, B, C
8. Portföy yönetiminin sektörel uygulamalarını analiz edebilecektir.				1, 12, 2, 3, 4	A, B, C
8.1. Sektör uygulamalarını değerlendirebilir.				1, 12, 2, 3, 4	A, B, C
8.2. Eleştiriler gerçekleştirir.				1, 12, 2, 3, 4	A, B, C
<b>Öğretim Yöntemleri</b>	1: Anlatım, 12: Örnek Olay, 2: Soru - Cevap, 3: Tartışma, 4: Alıştırma ve Uygulama				
<b>Ölçme Yöntemleri</b>	A: Yazılı sınav, B: Sözlü Sınav, C: Ödev				
<b>Ders Akışı</b>					
<b>Sıra</b>	<b>Konular</b>	<b>Ön Hazırlık</b>			
1	Yatırımın Temel Kavramları				
2	Finansal Yatırım ve Portföy Kavramı				
3	Finansal Risk Yönetimi				
4	Yatırımcı Fayda Fonksiyonu				
5	Portföy Yönetimine Giriş				
6	Portföy Yönetimi Kuramları				
7	Geleneksel Yaklaşım				
8	Ortlama-Varyans Yaklaşımı				
9	Faktör Modelleri Yaklaşımı				
10	Portföy Performansının Ölçülmesi				
11	Vadeli Piyasalarda Portföy Yönetimi				
12	Portföy Yönetimi Faaliyetlerinin Uygulamada Tanıtılması				
13	Portföy Yönetim Şirketlerinin Uygulamada Tanıtılması				
14	Uluslararası Piyasalar ve Portföy Yönetimi				
<b>Değerlendirme Yöntemleri</b>		<b>Sınava Katkısı</b>			
Ara Sınav		40			
Genel Sınav		60			

**İřletme ve Yönetim Bilimleri Fakültesi / Bankacılık ve Sigortacılık Programı**  
**2022 - 2023 Eğitim Öğretim Yılı**  
**YATIRIM ANALİZİ VE PORTFÖY YÖNETİMİ**  
**Syllabus**

**Kaynaklar**

Çıtak, Serdar, Finansal Yatırım Analizi, Nobel Yayınları  
Edwin J. Elton, Martin J. Gruber, Stephen J. Brown, William N. Goetzmann, Modern Portfolio Theory and Investment Analysis, Wiley