

Dersin Tanımı					
Adı	Kodu	Yarıyıl	T+U Saat	Kredi	AKTS
YATIRIM ANALİZİ VE PORTFÖY YÖNETİMİ	BAN4154050	Güz Dönemi	3+0	3	5
Ön Koşul Dersleri					
Önerilen Seçmeli Dersler					
Dersin Dili	Türkçe				
Dersin Seviyesi	Lisans				
Dersin Türü	Zorunlu				
Dersin Koordinatörü	Dr.Öğr.Üye. Ali Osman Serdar ÇITAK				
Dersi Verenler	Prof.Dr. Hasan DİNÇER				
Dersin Yardımcıları					
Dersin Amacı	Yatırım analizi ve portföy yönetimi için gerekli teorik çerçeveyi, araçları ve pratik konuları sunmaktır.				
Dersin İçeriği	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.				
Dersin Öğrenme Çıktıları				Öğretim Yöntemleri	Ölçme Yöntemleri
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
Öğretim Yöntemleri	1: Anlatım, 12: Örnek Olay, 2: Soru - Cevap, 3: Tartışma, 4: Alıştırma ve Uygulama				
Ölçme Yöntemleri	A: Yazılı sınav, B: Sözlü Sınav, C: Ödev				
Ders Akışı					
Sıra	Konular	Ön Hazırlık			
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				
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					