



## Ders Bilgi Formu

Ders Adı	Kodu	Yerel Kredi	AKTS	Ders (saat/hafta)	Uygulama (saat/hafta)	Laboratuvar (saat/hafta)
Yatırım Analizi ve Portföy Yönetimi	ISL3770	3	5	3	0	0

Önkoşullar	Yok
------------	-----

Yarıyıl	Güz, Bahar
---------	------------

Dersin Dili	İngilizce, Türkçe
-------------	-------------------

Dersin Seviyesi	Lisans Seviyesi
-----------------	-----------------

Ders Kategorisi	Temel Meslek Dersleri
-----------------	-----------------------

Dersin Veriliş Şekli	Yüz yüze
----------------------	----------

Dersi Sunan Akademik Birim	İşletme Bölümü
----------------------------	----------------

Dersin Koordinatörü	Seda Canikli
---------------------	--------------

Dersi Veren(ler)	Seda Canikli
------------------	--------------

Asistan(lar)ı	
---------------	--

Dersin Amacı	Dersin amacı, öğrencilerin modern portföy teorisinin esaslarını, varlık seçim kriterlerini, farklı menkul değerleri değerlendirmede kullanılan analiz tekniklerini kavramalarını sağlamaktır. Bu alanda piyasa profesyonelleri öğrencilerle buluşarak gerçek dünyada nasıl yatırım yapılacağına ilişkin derse katkıda bulunacaktır.
--------------	---

Dersin İçeriği	Finansal Risk Kavramı ve Riskin Ölçülmesi, Finansal Varlık Getirilerinin Korelasyon Yapısı, Faktor Modelleri ve APT, Etkin Piyasa Hipotezi, Risk Sermayesi ve Riskte Maruz Değer Uygulamaları, Yatırım Süreçlerinin Değerlendirilmesi
----------------	---

Opsiyonel Program Bileşenleri	Yok
-------------------------------	-----

### Ders Öğrenim Çıktıları

1	Öğrenciler, finansal varlık analizi konusu hakkında bilgi sahibi olurlar;
2	finansal risk kavramı ve riskin ölçülmesi yöntem ve tekniklerini öğrenirler;
3	portföy kuramı hakkında bilgi sahibi olurlar;
4	finansal varlık analiz yöntem ve tekniklerini öğrenirler;
5	yatırım stratejileri hakkında bilgi sahibi olurlar.

### Haftalık Konular ve İlgili Ön Hazırlık Çalışmaları

Hafta	Konular	Ön Hazırlık
1	Risk Kavramı ve Riskin Ölçülmesi	Elton vd., 2014
2	Finansal Varlık Getirilerinin Korelasyon Yapısı	Elton vd., 2014
3	Optimum Portföy Seçimi	Elton vd., 2014, Reily vd. 2017
4	Beklenen Getirinin Hesaplanması	Elton vd., 2014, Reily vd. 2017
5	Finansal Varlıkları Değerleme Modeli	Elton vd., 2014, Reily vd. 2017
6	Faktor Modelleri ve APT	Elton vd., 2014
7	Finansal Varlık Analizleri	Elton vd., 2014
8	Midterm 1 / Practice or Review	

9	Risk Sermayesi, Riske Maruz Değer Uygulamalar, ESG Riski	Elton vd., 2014
10	Uluslararası Çeşitlendirme	Elton vd., 2014
11	Etkin Piyasalar Teorisi	McMillian vd. 2011
12	Faiz ve Vade Yapısı Teorileri	Elton vd., 2014
13	Davranışsal Finans ve Varlık Fiyatlarına Etkisi	McMillian vd. 2011
14	Teknik Analiz	Elton vd., 2014
15	Final	
16		

## Değerlendirme Sistemi

Etkinlikler	Sayı	Katkı Payı
Devam/Katılım		
Laboratuvar		
Uygulama		
Arazi Çalışması		
Derse Özgü Staj		
Küçük Sınavlar/Stüdyo Kritiği		
Ödev	1	15
Sunum/Jüri	1	15
Projeler		
Seminer/Workshop		
Ara Sınavlar	1	30
Final	1	40
<b>Dönem İçi Çalışmaların Başarı Notuna Katkısı</b>		60
<b>Final Sınavının Başarı Notuna Katkısı</b>		40
<b>TOPLAM</b>		100

## AKTS İşyükü Tablosu

Etkinlikler	Sayı	Süresi (Saat)	Toplam İşyükü
Ders Saati	13	3	39
Laboratuvar	0	0	0
Uygulama	0	0	0
Arazi Çalışması			
Sınıf Dışı Ders Çalışması	13	5	65
Derse Özgü Staj			
Ödev	0	0	0
Küçük Sınavlar/Stüdyo Kritiği			
Projeler			
Sunum / Seminer			
Ara Sınavlar (Sınav Süresi + Sınav Hazırlık Süresi)	2	16	32

Final (Sınav Süresi + Sınav Hazırlık Süresi)	1	20	20
<b>Toplam İşyükü</b>			156
<b>Toplam İşyükü / 30(s)</b>			5.20
<b>AKTS Kredisi</b>			5

Diğer Notlar	Yok
--------------	-----