



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	4	3	0	0

Önkoşullar	ISL3662
------------	---------

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

Dersin Dili	İngilizce, Türkçe
Dersin Seviyesi	Lisans Seviyesi
Dersin Türü	Seçmeli @ İktisat Lisans Programı Seçmeli @ İşletme Lisans Programı
Ders Kategorisi	Temel Meslek Dersleri
Dersin Veriliş Şekli	Yüz yüze

Dersi Sunan Akademik Birim	İşletme Bölümü
Dersin Koordinatörü	Güler Aras
Dersi Veren(ler)	Fazıl Kayıkçı
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 Riske Maruz Değer Uygulamaları, Yatırım Süreçlerinin Değerlendirilmesi
Opsiyonel Program Bileşenleri	Yok

Ders Öğrenim Çıktıları	
1	Öğrenciler, finansal varlık analizi konusu hakkında bilgi sahibi olurlar;
2	portföy kuramını öğrenirler;
3	finansal varlık analiz yöntem ve tekniklerini öğrenirler;
4	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		
9	Risk Sermayesi ve Riske Maruz Değer Uygulamalar	Elton vd., 2014
10	Uluslararası Çeşitlendirme	Elton vd., 2014
11	Etkin Piyasalar Teorisi	Elton vd., 2014
12	Faiz ve Vade Yapısı Teorileri	Elton vd., 2014
13	Davranışsal Finans ve Varlık Fiyatlarına Etkisi	Elton vd., 2014
14	Yatırım Süreçlerinin Değerlendirilmesi	Elton vd., 2014
15		

Değerlendirme Sistemi

Etkinlikler	Sayı	Katkı Payı
Devam/Katılım		
Laboratuar		
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
Dönem İçi Çalışmaların Başarı Notuna Katkısı		60
Final Sınavının Başarı Notuna Katkısı		40
TOPLAM		100

AKTS İşyükü Tablosu

Etkinlikler	Sayı	Süresi (Saat)	Toplam İşyükü
Ders Saati	14	3	42
Laboratuar	14	1	14
Uygulama			
Arazi Çalışması			
Sınıf Dışı Ders Çalışması	14	2	28
Derse Özgü Staj			
Ödev	5	3	15
Küçük Sınavlar/Stüdyo Kritiği			
Projeler			
Sunum / Seminer			
Ara Sınavlar (Sınav Süresi + Sınav Hazırlık Süresi)	1	16	16

Final (Sınav Süresi + Sınav Hazırlık Süresi)	1	16	16
Toplam İşyükü			131
Toplam İşyükü / 30(s)			4.37
AKTS Kredisi			4

Diğer Notlar	Yok
--------------	-----