



Ders Bilgi Formu

Ders Adı	Kodu	Yerel Kredi	AKTS	Ders (saat/hafta)	Uygulama (saat/hafta)	Laboratuvar (saat/hafta)
Yatırım Analizi ve Portföy Yönetimi	ISL6153	3	7.5	3	0	0

Önkoşullar	Yok
------------	-----

Yarıyıl	Bahar
---------	-------

Dersin Dili	Türkçe
-------------	--------

Dersin Seviyesi	Doktora Seviyesi
-----------------	------------------

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

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

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

Dersin Koordinatörü	Atanmamış
---------------------	-----------

Dersi Veren(ler)	Güler Aras
------------------	------------

Asistan(lar)ı	Özlem Kutlu Furtuna
---------------	---------------------

Dersin Amacı	Bu dersin amacı, modern portföy teorisinin esaslarını, varlık seçim kriterlerini, farklı menkul değerleri değerlendirmede kullanılan yatırım analizinin temellerini ve tekniklerini kavramalarını sağlamaktır.
--------------	--

Dersin İçeriği	Finansal Varlık, Piyasalar ve Enstrümanlar, 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 konusunu öğrenirler.
---	---

2	Portföy kuramı hakkında bilgi sahibi olurlar.
---	---

3	- Uygulama yöntem ve tekniklerini öğrenirler
---	--

4	Yatırım stratejileri hakkında bilgi sahibi olurlar.
---	---

Haftalık Konular ve İlgili Ön Hazırlık Çalışmaları

Hafta	Konular	Ön Hazırlık
1	Finansal Varlık, Piyasalar ve Enstrümanlar	Pike&Neale2005; ss.33-74
2	Risk Kavramı ve Riskin Ölçülmesi	Pike&Neale2005; ss.277-303
3	Finansal Varlık Getirilerinin Korelasyon Yapısı	Pike&Neale2005; ss.280-303
4	Optimum Portföy Seçimi	Pike&Neale2005; ss.308-329
5	Beklenen Getirinin Hesaplanması	Pike&Neale2005; ss.367-394
6	Finansal Varlıkları Değerleme Modeli	Pike&Neale2005; ss.367-394
7	Faktor Modelleri ve APT	Pike&Neale2005; ss.367-394
8	Vize Sınavı	
9	Etkin Piyasa Hipotezi	Pike&Neale2005; ss.220-241

10	Finansal Varlık Analizleri	Pike&Neale2005; ss.308-329
11	Faiz Vade Yapısı Teorileri	Pike&Neale2005; ss.151-182
12	Risk Sermayesi ve Riske Maruz Değer Uygulamaları	Pike&Neale2005; ss.275-303
13	Yatırım Süreçlerinin Değerlendirilmesi	Pike&Neale2005; ss.275-303
14	Örnek Finansal Olay Çalışmaları	
15	Örnek Finansal Olay Çalışmaları	

Değerlendirme Sistemi

Etkinlikler	Sayı	Katkı Payı
Devam/Katılım		
Laboratuvar		
Uygulama		
Arazi Çalışması		
Derse Özgü Staj		
Küçük Sınavlar/Stüdyo Kritiği		
Ödev	1	15
Sunum/Jüri	3	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
Laboratuvar			
Uygulama			
Arazi Çalışması			
Sınıf Dışı Ders Çalışması	14	6	84
Derse Özgü Staj			
Ödev			
Küçük Sınavlar/Stüdyo Kritiği			
Projeler	1	20	20
Sunum / Seminer	2	25	50
Ara Sınavlar (Sınav Süresi + Sınav Hazırlık Süresi)	1	14	14
Final (Sınav Süresi + Sınav Hazırlık Süresi)	1	15	15
Toplam İşyükü			225

	Toplam İşyükü / 30(s)	7.50
	AKTS Kredisi	7.5

Diğer Notlar	Yok
--------------	-----