

YATIRIM ANALİZİ VE PORTFÖY YÖNETİMİ



Büyükütlu Uygulamalı Bilimler Fakültesi Muhasebe ve Finans Yönetimi					
DERS BİLGİLERİ					
Ders Kodu	Ders Adı	Kredi Teorik+ Uygulama (Saat)	Kredi Toplam	AK TS	Yarı Yılı
MUH-3107	Yatırım Analizi ve Portföy Yönetimi	3,0	3,0	4,0	5. Yarıyıl
Dersin Dili	Türkçe				
Ders Düzeyi	LİSANS TYYÇ:6.DÜZEY EQF-LLL:6.DÜZEY QF-EHEA:1.DÜZEY				
Dersin Türü	Zorunlu				
Dersi Verenler	Dr. Öğretim Üyesi İrfan SEKTİOĞLU				

DERSİN AMACI

Portföy yönetimi kavramının geleneksel ve modern teoriler ışığında incelenmesi ve portföy yönetimi modelleri uygulamaları ile farklı seçenekler içinden karlı olanın seçilmesine yönelik çalışmaların yapılması ve tartışılması amaçlanmaktadır.

DERSİN ÖĞRENME ÇIKTILARI
Hisse senedi, tahvil v.b. yatırım araçlarını iyi tanır.
Minimum risk ile maksimum getirinin sağlanmasını öğrenir.
Kısa, orta ve uzun vadeli portföy hazırlayabilir.
Temel ve teknik analiz yapabilme yetisi kazanır.
Ülke ve dünyada yaşanan ekonomik gelişmeleri anlayıp portföy revize işlemlerini yapabilir.

HAFTALIK KONULAR

Hafta	Konular
1	Temel Kavramlar: Yatırım, hisse senedi, tahvil, bono, fon çeşitleri, özellikleri, portföy, yatırım portföyü, portföy yönetimi Sınıfıçı anlatım ve tartışma
2	Şirketler ve yatırımlar için değerlendirme yöntemleri ve uygulamalar Sınıfıçı anlatım ve tartışma ve uygulama
3	Risk, risk türleri, risk ölçümü, risk ölçüm yöntemleri Sınıfıçı anlatım ve tartışma
4	Kur, faiz, sermaye ve vadeli işlem ve opsiyon alternatifleri, riskleri ve risk ölçümleri

ISPARTA UYGULAMALI BİLİMLER ÜNİVERSİTESİ
PROGRAM DERS BİLGİ PAKETİ
DERS İÇERİĞİ



	Sınıfıçı anlatım ve tartışma ve uygulama
5	Riske Maruz Değer (VaR) kavramı, modelleri, ölçümü, portföy riski ölçümünde kullanımı Sınıfıçı anlatım ve tartışma
6	Geleneksel portföy teorisi, modern portföy teorisi, geleneksel ve modern portföy teorileri arasındaki benzer ve farklı yönler Sınıfıçı anlatım ve tartışma
7	Markowitz portföy teorisi, karşılaştırmalar. Finansal varlıkların getirilerinin ve risklerinin, portföy getirisinin ve riskinin ölçümü, getiriler arasındaki hesaplamalar ve uygulamalar Sınıfıçı anlatım ve tartışma
8	Arasınav.
9	Bono, hisse senedi getirilerinin hesaplanması Sınıfıçı anlatım ve tartışma ve uygulama
10	Sermaye varlıklarını fiyatlama modeli (CAPM) ve uygulamalar Sınıfıçı anlatım ve tartışma ve uygulama
11	Arbitraj fiyatlama modeli (APM) ve uygulamalar Sınıfıçı anlatım ve tartışma
12	Riskler karşısında portföy yönetimi Sınıfıçı anlatım ve tartışma
13	Uluslararası portföy yönetimi Sınıfıçı anlatım ve tartışma
14	Genel tekrar ve uygulama Sınıfıçı anlatım ve tartışma

DEĞERLENDİRME

ARASINAV	%40
FİNAL	%60
TOPLAM	%100

KAYNAKLAR

Ali CEYLAN - SPK Lisanslama Çalışma Notları.
TSPB Eğitim Yayınları.