



Ders Adı	Kodu	Yarıyıl	T+U Saat	AKTS	Z / S
Yatırım Analizi ve Portföy Yönetimi	BAF302	6	3 + 0	6,0	Zorunlu
Birim Bölüm	Finans ve Bankacılık - Lisans (Yüzyüze)				
Amaç	Finansal piyasa araçlarının değerlendirilmesini ve portföy teorisi öğrenerek yatırımları yönetme ve karar alma yeteneği kazandırmaktır.				
Ders İçeriği	Finansal piyasa araçlarının analizi ve değerlendirilmesi, portföy teorisi ve yaklaşımları ile uygulanması				
Ders Veren	Dr. Öğr. Üyesi Serap KAMŞLI				
Ders Kaynakları	Mehmet Baha Karan, Yatırım Analizi ve Portföy Yönetimi, Gazi Kitabevi.				

Hafta	Konu
1	Portföy Kavramı ve Portföy Yönetim Süreci
2	Tek Bir Varlık için Beklenen Getirinin ve Riskin Ölçülmesi
3	Portföyün Beklenen Getirisinin ve Riskinin Ölçülmesi
4	Portföyün Beklenen Getirisinin ve Riskinin Ölçülmesi
5	Diğer Risk Ölçütleri ve Ölçümleri
6	Hisse Senedi Değerlemesi
7	Tahvil Değerlemesi
8	Portföy Yönetim Stratejileri
9	Pasif Portföy Yönetim Stratejileri
10	Aktif Portföy Yönetimi ve Temel Analiz
11	Aktif Portföy Yönetimi ve Teknik Analiz
12	Sermaye Varlıklarını Fiyatlama Modeli
14	Arbitraj Fiyatlama Modeli ve Faktör Modelleri

Ders İş Yükü	Çalışma Türü / Öğretim Metotları	Süresi (Saat)	Sayı
Dinleme ve anlamlandırma	Ders	6	14
Dinleme ve anlamlandırma, gözlem/durumları işleme, eleştirel düşünme, soru geliştirme	Tartışmalı Ders	2	14
Araştırma – yaşam boyu öğrenme, durumları işleme, soru geliştirme, yorumlama, sunum	Sözlü	2	14
Ara Sınav 1		1	1
Final		1	1
Ders İş Yükü:		142	
AKTS (Ders İş Yükü / 25.5):		5,57	

Program Çıktıları	
1	Paranın zaman değeri, risk-getiri dengesi gibi finans alanıyla ilgili temel kavramlar, teoriler ve uygulamalar hakkında güncel ve teorik bilgilere sahip olur.
2	Bankacılık sektörüyle ilgili temel bilgi, ilke ve uygulamaları bilir ve edindiği bilgi ve becerileri finansal süreçleri çözmeye kullanır, analitik ve stratejik düşünerek bankacılıkla ilgili verileri analiz edebilir.
3	Alanla ilgili edindiği bilgiler çerçevesinde, banka, yatırım şirketi, borsa vb. finansal kurumları, finansal piyasaları öğrenir ve bu piyasalarda işlem gören hisse senetleri, tahviller vb. finansal ürünleri analiz ederek, değerlendirebilir.
4	Alanla ilgili konularda ekip çalışmasının getireceği sorumluluklara açık olur.
5	Alanla ilgili konularda bireysel anlamda sorumluluğa açık olur.
6	Ulusal veya uluslararası finansal sistemlerin işleyişini anlayabilir, iflas, kriz vb. finansal olaylar arasında neden-sonuç ilişkisi kurar ve yorumlama becerisine sahip olur.
7	Finans ve bankacılık sektörüyle ilgili bilgi ve becerileri yazılı ve sözlü olarak aktarır ve iletişim kurar.
8	Finansal konularda gelişmeleri takip edebilecek ve iletişim kurabilecek düzeyde bir yabancı dili anlayabilir ve kullanabilir.
9	Yatırım analizi ve portföy yönetimi başta olmak üzere finans ve bankacılık sektörünün gerektirdiği düzeyde bilgi, iletişim teknolojileri ve paket programları kullanabilir.
10	Alanla ilgili konularda toplumsal refahı ön planda tutar ve etik değerlere uygun değerlendirerek yorum yapar.
11	Bankacılık sektörünün iç ve dış çevresinde tüm paydaşlarını gözetecek şekilde ilişkileri izleyebilir, sorunları tanımlar ve çözüm önerileri geliştirme yetkinliğine sahip olur.
12	Çevreye, sosyal sorumluluğa, kaliteye ve yenilikçiliğe her şart altında önem verir ve finansal verileri bu doğrultuda toplayıp değerlendirir.
13	Finans ve bankacılık konularında edindiği bilgi ve becerileri sürekli geliştirerek ömür boyu öğrenmeye açık ve bankacılık sektörüyle ilgili güncel gereksinimleri karşılama becerisine sahiptir.
14	Finans ve bankacılık sektörüyle ilgili bilgileri eleştirel bir bakış açısıyla değerlendirebilir.
15	Finans ve bankacılık sektörü ile edindiği bilgi birikimi ile, küresel ekonomide ve uluslararası bankacılıkta yaşanan süreçleri izleyebilir.

Ders Öğrenme Çıktısı - Program Çıktıları (1 -5 Puan Aralığı)

Ders Öğrenme Çıktısı	PÇ 1	PÇ 2	PÇ 3	PÇ 4	PÇ 5	PÇ 6	PÇ 7	PÇ 8	PÇ 9	PÇ 10	PÇ 11	PÇ 12	PÇ 13	PÇ 14	PÇ 15
Portföylerin performansını değerlendirebilir ve karşılaştırabilir.	3	3	4	2	3	4	2	2	4	3	5	3	5	4	5
Portföy yönetim stratejilerini değerlendirebilir.	3	3	1	2	3	4	2	2	4	3	5	3	5	4	2
Varlık fiyatlama modellerini analiz edebilir.	3	3	4	2	3	4	2	2	4	3	5	3	5	4	5
Tek bir varlık ve portföy için risk ve getiri hesaplayabilir.	3	3	4	2	3	4	2	2	4	3	5	3	5	4	5
Ortalama Değer	3	3	3,25	2	3	4	2	2	4	3	5	3	5	4	4,25

<https://ebs.bilecik.edu.tr/pdf/dersbilgigetir/341156>