



| Ders Adı                            | Kodu    | Yarıyıl | T+U Saat | AKTS | Z / S   |
|-------------------------------------|---------|---------|----------|------|---------|
| Yatırım Analizi ve Portföy Yönetimi | BSI5029 |         | 3 + 0    | 7,5  | Seçmeli |

|                 |                                                                                                                                   |
|-----------------|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| Birim Bölüm     | Bankacılık ve Sigortacılık - YL - Lisansüstü (Yüzyüze)                                                                            |
| Amaç            | Finansal piyasa araçlarının değerlemesini ve portföy teorisi öğrenerek yatırımları yönetme ve karar alma yeteneği kazandırmaktır. |
| Ders İçeriği    | Finansal piyasa araçlarını analizi ve değerlemesi, portföy teorisi ve yaklaşımları ile uygulanması                                |
| Ders Kaynakları | Mehmet Baha Karan, Yatırım Analizi ve Portföy Yönetimi, Gazi Kitabevi.                                                            |

| Hafta | Konu                                                              |
|-------|-------------------------------------------------------------------|
| 1     | Finansal Çevre, Araçlar ve Analizi                                |
| 2     | Tahvil Değerleme                                                  |
| 3     | Hisse Senedi Değerleme                                            |
| 4     | Firma Değerleme                                                   |
| 5     | Geleneksel Portföy Analizi                                        |
| 6     | Geleneksel Portföy Analizi                                        |
| 7     | Geleneksel Portföy Analizi                                        |
| 8     | Modern Portföy Teorisi - Markowitz                                |
| 9     | Modern Portföy Teorisi - İndeks Modeli                            |
| 10    | Modern Portföy Teorisi - Finansal Varlıkları Fiyatlandırma Modeli |
| 11    | Opsiyon Teorisi                                                   |
| 12    | Portföy Analizi ve Yönetimi                                       |
| 13    | Portföy Analizi ve Yönetimi                                       |
| 14    | Portföy Analizi ve Yönetimi                                       |

#### Program Çıktıları

- Finans alanıyla ilgili temel kavramlara, güncel ve teorik bilgilere sahip olmak
- Alanla ilgili edindiği bilgi ve becerileri finansal süreçleri çözmede kullanmak, analitik ve stratejik düşünerek uygulamaya geçirebilmek
- Alanla ilgili edindiği bilgiler çerçevesinde finansal piyasaları ve finansal kurumları değerlendirebilmek
- Alanla ilgili konularda ekip çalışmasının getireceği sorumluluklara açık olmak
- Alanla ilgili konularda bireysel anlamda sorumluluğa açık olmak
- Finansal olaylar arasında neden-sonuç ilişkisi kurabilmek ve yorumlayabilmek
- Finansal konularla ilgili bilgi ve becerileri yazılı ve sözlü olarak aktarabilmek, iletişim kurabilmek
- Finansal konularda gelişmeleri takip edebilecek ve iletişim kurabilecek düzeyde bir yabancı dili anlamak ve kullanmak
- Alanın gerektirdiği düzeyde bilgi, iletişim teknolojileri ve paket programları kullanabilmek
- Alanla ilgili konularda toplumsal refahı ön planda tutabilmek ve etik değerlere uygun değerlendirebilmek ve yorum yapabilmek
- Finansal piyasa ve kurumların iç ve dış çevresinde tüm paydaşlarını gözeterek ilişkilerini izleyebilmek
- Çevreye, sosyal sorumluluğa, kaliteye ve yenilikçiliğe her şart altında önem vermek, verileri ilgili doğrultuda toplayabilmek
- Bankacılık ve finans konularında edindiği bilgi ve becerileri sürekli geliştirerek ömür boyu öğrenmeye açık olmak
- Alanla ilgili konularda bilgi ve becerileri eleştirel bir bakış açısıyla değerlendirebilmek
- Genelde finans, özelde ise bankacılık ve sigortacılık konuları ile ilgili bilgi birikimine sahip olarak, ekonomide yaşanan süreçleri izleyebilmek

#### 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 |
|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|------|------|------|------|------|------|------|------|------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|
| Yatırım analizi ve portföy yönetiminde kullanılan teknik ve metodlar ile, bunların temelinde yatan teori ve kavramlar hakkında bilgi sahibi olmak. | -    | -    | -    | -    | -    | -    | -    | -    | -    | -     | -     | -     | -     | -     | -     |
| Temel yatırım stratejilerini anlamak ve nasıl uygulandıklarını bilmek.                                                                             | -    | -    | -    | -    | -    | -    | -    | -    | -    | -     | -     | -     | -     | -     | -     |
| Yatırım araçlarını, birbirinden farklarını, yatırım ortamını ve piyasaları tanımak.                                                                | -    | -    | -    | -    | -    | -    | -    | -    | -    | -     | -     | -     | -     | -     | -     |
| Yatırım portföyü oluşturma ve performansını değerlendirme konusunda teori ile uygulamayı entegre edebilmek.                                        | -    | -    | -    | -    | -    | -    | -    | -    | -    | -     | -     | -     | -     | -     | -     |
| Ortalama Değer                                                                                                                                     | -    | -    | -    | -    | -    | -    | -    | -    | -    | -     | -     | -     | -     | -     | -     |