

GENEL TANIM / GENERAL DESCRIPTION

Ders Adı / Course Name	Investment Analysis and Portfolio Management / Investment Analysis and Portfolio Management	
Ders Kodu / Course Code	9204055412012	
Ders Türü / Course Type		
Ders Seviyesi / Course Level	Second Cycle / Second Cycle	
Ders Akts Kredi / ECTS	6.00	
Haftalık Ders Saati (Kuramsal) / Course Hours For Week (Theoretical)	3.00	
Haftalık Uygulama Saati / Course Hours For Week (Objected)	0.00	
Haftalık Laboratuvar Saati / Course Hours For Week (Laboratory)	0.00	
Dersin Verildiği Yıl / Year	1	
Öğretim Sistemi / Teaching System	Face to Face / Face to Face	
Eğitim Dili / Education Language	Turkish / Turkish	
Ön Koşulu Olan Ders(ler) / Precondition Courses	Yok	None
Amacı / Purpose	<ul style="list-style-type: none"> •Öğrencilere yatırım çevresi ve finansal piyasalar ile ilgili temel kavramları tanıtmak •Portföy teorisi, menkul kıymet analizi ve portföy performansının değerlendirilmesi konularını açıklamak 	<ul style="list-style-type: none"> •To define the investment environment and basic concepts about financial markets. •To explain portfolio theory, security analysis and evaluation of portfolio performance
İçeriği / Content	Bu derste yatırım analizi ile ilgili temel hususların anlatılarak, portföy değerlendirilmesi ve menkul kıymet analizi ile ilgili teknik ve yöntemlerin öğretilmesi amaçlanmaktadır. Bu doğrultuda yatırım unsurları, portföy teorisi, sabit getirili menkul kıymetler, menkul kıymet analizi, türev araçlar ve aktif yatırım yönetimi konuları üzerinde durulacaktır.	This course aims to define the investment environment and basic concepts about financial markets. In this context elements of investments, portfolio theory, fixed-income securities, security analysis, derivative assets and active investment management will be explained.
Önerilen Diğer Hususlar / Recommended Other Considerations	Yok	None
Staj Durumu / Internship Status	Yok	None
Kitap / Malzemesi / Önerilen Kaynaklar / Books / Materials / Recommended Reading	Bodie, Z., Kane, A. and Marcus, A.J. (2009), "Investments", Eight Edition, McGraw-Hill - Karan, Mehmet Baha (2001), "Yatırım Analizi ve Portföy Yönetimi", Gazi Kitabevi	- Bodie, Z., Kane, A. and Marcus, A.J. (2009), "Investments", Eight Edition, McGraw-Hill - Karan, Mehmet Baha (2001), "Yatırım Analizi ve Portföy Yönetimi", Gazi Kitabevi
Öğretim Üyesi (Üyeleri) / Faculty Member (Members)	Prof. Dr. Dilek Demirhan	Prof. Dr. Dilek Demirhan

ÖĞRENME ÇIKTILARI / LEARNING OUTCOMES

1	Yatırım çevresi ve finansal piyasalar ile ilgili temel kavramları anlayabilmek	To be able to understand the investment environment and basic concepts about financial markets
2	Portföy yönetimi, portföy performansının değerlendirilmesi ve menkul kıymet analizi ile ilgili temel kavramları bilmek, kullanılan teknik ve yöntemler hakkında bilgi sahibi olarak bunları uygulayabilmek	To learn basic concepts and techniques and methods about portfolio management, evaluation of portfolio performance and security analysis, and to be able to use them
3	Yatırım yönetimi ile ilgili edindiği kuramsal ve uygulamalı bilgileri gerçek hayattaki problemlerin çözümünde kullanabilmek	To be able to use theoretical and practical knowledge gained about investment analysis and portfolio management

HAFTALIK DERS İÇERİĞİ / DETAILED COURSE OUTLINE

Hafta / Week					
1	Teorik Dersler / Theoretical	Uygulama	Lab	Öğretim Yöntem ve Teknikleri/Teaching Methods Techniques	Ön Hazırlık / Preliminary
	Yatırım Çevresi ve Yatırımla İlgili Temel Kavramlar				
	Background and Issues				
2	Teorik Dersler / Theoretical	Uygulama	Lab	Öğretim Yöntem ve Teknikleri/Teaching Methods Techniques	Ön Hazırlık / Preliminary
	Finansal Piyasalar ve Araçlar				
	Financial Markets and Instruments				
3	Teorik Dersler / Theoretical	Uygulama	Lab	Öğretim Yöntem ve Teknikleri/Teaching Methods Techniques	Ön Hazırlık / Preliminary
	Yatırımcılar ve Yatırım Süreci				
	Investors and the Investment Process				
4	Teorik Dersler / Theoretical	Uygulama	Lab	Öğretim Yöntem ve Teknikleri/Teaching Methods Techniques	Ön Hazırlık / Preliminary
	Risk ve Getiri Kavramları				
	Risk and Return				
5	Teorik Dersler / Theoretical	Uygulama	Lab	Öğretim Yöntem ve Teknikleri/Teaching Methods Techniques	Ön Hazırlık / Preliminary
	Portföy Riski ve Çeşitlendirme				
	Efficient Diversification				

	Teorik Dersler / Theoretical	Uygulama	Lab	Öğretim Yöntem ve Teknikleri/Teaching Methods Techniques	Ön Hazırlık / Preliminary
6	Sermaye Varlıklarını Fiyatlandırma ve Arbitraj Fiyatlama Modeli				
	CAPM and Arbitrage Pricing Theory				
7	Etkin Piyasalar Hipotezi				
	The Efficient Market Hypothesis				
8	Ara Sınav				
	Midterm				
9	Sabit Getirili Menkul Kıymetler: Tahvil Fiyatları ve Getirisi				
	Fixed Income Securities: Bond Prices and Yields				
10	Menkul Kıymet Analizi: Makroekonomik Analiz ve Sektör Analizi				
	Security Analysis: Macroeconomic and Industry Analysis				
11	Menkul Kıymet Analizi: Hisse Senedi Değerlemesi				
	Security Analysis: Equity Valuation				

	Teorik Dersler / Theoretical	Uygulama	Lab	Öğretim Yöntem ve Teknikleri/Teaching Methods Techniques	Ön Hazırlık / Preliminary
12	Menkul Kıymet Analizi: Teknik Analiz				
	Security Analysis: Technical Analysis				
13	Türev Araçlar: Opsiyonlar				
	Derivative Assets: Options				
14	Türev Araçlar: Gelecek Sözleşmeleri				
	Derivative Assets: Futures				
15	Portföy Performansının Değerlendirilmesi				
	Portfolio Performance Evaluation				
16	Final Sınavı				
	Final Exam				

DEĞERLENDİRME / EVALUATION

Yarıyıl (Yıl) İçi Etkinlikleri / Term (or Year) Learning Activities	Sayı / Number	Katkı Yüzdesi / Percentage of Contribution (%)
Ara Sınav / Midterm Examination	1	100
Toplam / Total:	1	100
Başarı Notuna Katkı Yüzdesi / Contribution to Success Grade(%):		40

Yarıyıl (Yıl) Sonu Etkinlikleri / End Of Term (or Year) Learning Activities	Sayı / Number	Katkı Yüzdesi / Percentage of Contribution (%)
Final Sınavı / Final Examination	1	100
Toplam / Total:	1	100
Başarı Notuna Katkı Yüzdesi / Contribution to Success Grade(%):		60

Etkinliklerinin Başarı Notuna Katkı Yüzdesi(%) Toplamı / Total Percentage of Contribution (%) to Success Grade:	100
Değerlendirme Tipi / Evaluation Type:	

İŞ YÜKÜ / WORKLOADS

Etkinlikler / Workloads	Sayı / Number	Süresi (Saat) / Duration (Hours)	Toplam İş Yüğü (Saat) / Total Work Load (Hour)
Derse Katılım / Attending Lectures	16	3.00	48.00
Ara Sınav İçin Bireysel Çalışma / Individual Study for Mid term Examination	12	2.00	24.00
Final Sınavı için Bireysel Çalışma / Individual Study for Final Examination	20	2.00	40.00
Final Sınavı / Final Examination	1	2.00	2.00
Ara Sınav / Midterm Examination	1	2.00	2.00
Ödev Problemleri için Bireysel Çalışma / Individual Study for Homework Problems	10	4.00	40.00
Bireysel Çalışma / Self Study	20	1.00	20.00
Toplam / Total:	80	16.00	176.00

PROGRAM VE ÖĞRENME ÇIKTISI / PROGRAM LEARNING OUTCOMES

Öğrenme Çıktıları / Learning Outcomes	Program Çıktıları / Program Outcomes																
	1.1.1	1.1.2	1.1.3	1.1.4	1.1.5	1.1.6	1.1.7	1.1.8	1.1.9	1.1.10	1.1.11	1.1.12	1.1.13	1.1.14	1.1.15	1.1.16	1.1.17
1.Yatırım çevresi ve finansal piyasalar ile ilgili temel kavramları anlayabilmek / To be able to understand the investment environment and basic concepts about financial markets				4		5					4						4
2.Portföy yönetimi, portföy performansının değerlendirilmesi ve menkul kıymet analizi ile ilgili temel kavramları bilmek, kullanılan teknik ve yöntemler hakkında bilgi sahibi olarak bunları uygulayabilmek / To learn basic concepts and techniques and methods about portfolio management, evaluation of portfolio performance and security analysis, and to be able to use them	3	3	5		4		5		4		5		4	4		5	
3.Yatırım yönetimi ile ilgili edindiği kuramsal ve uygulamalı bilgileri gerçek hayattaki problemlerin çözümünde kullanabilmek / To be able to use theoretical and practical knowledge gained about investment analysis and portfolio management					5			3				4	4		4		4

Katkı Düzeyi / Contribution Level : 1-Çok Düşük / Very low, 2-Düşük / Low, 3-Orta / Moderate, 4-Yüksek / High, 5-Çok Yüksek / Very high