

Genel Bilgiler

Dersin Amacı

Bu dersin amacı, finansal varlık türleri ve finansal kurumlara değinerek, finansal varlıklara yatırım süreci ve bu yatırım sürecinin işleyiş mekanizması hakkında bilgi vermektir.

Dersin İçeriği

Dersin içeriğini yatırım ortamı ve piyasa oyuncuları, menkul kıymet borsaları, portföy risk ve getirisi, etkin portföy seçimi, sermaye varlıklarını fiyatlama modeli, arbitraj fiyatlama teorisi oluşturmaktadır.

Dersin Kitabı / Malzemesi / Önerilen Kaynaklar

Mehmet Baha Karan, Yatırım Analizi ve Portföy Yönetimi, Gazi Kitabevi, 2011 Ali Ceylan – Turhan Korkmaz, Borsada Uygulamalı Portföy Yönetimi, Ekin Kitabevi, 1998 Hüseyin Dağılı, Sermaye Piyasası ve Portföy Analizi, Derya Kitabevi, 2010 Serpil Canbaş – Hatice Doğukanlı, Finansal Pazarlar, Karahan Kitabevi, 2017

Planlanan Öğrenme Etkinlikleri ve Öğretme Yöntemleri

Bulunmamaktadır.

Ders İçin Önerilen Diğer Hususlar

Bulunmamaktadır.

Dersi Veren Öğretim Elemanı Yardımcıları

Bulunmamaktadır.

Dersin Verilişi

Yüz yüze

Dersi Veren Öğretim Elemanları

Arş. Gör. İrem Helvacıoğlu Prof. Dr. Çağatay Başarır

Program Çıktısı

1. Finansal piyasalar ve yatırım araçları hakkında bilgi sahibi olur.
2. Portföy yatırımının nasıl yapıldığını yorumlar.
3. Finansal varlık türleri ve finansal kurumlar hakkında bilgi sahibi olur.
4. Portföy performansını hesaplar.
5. Portföy yönetimindeki riskler ve etkilerini açıklar.

Haftalık İçerikler

Hazırlık Sıra Bilgileri	Laboratuvar	Öğretim Metodları	Teorik	Uygulama
1		Anlatım	Finansal Piyasalar, Hisse Senedi Piyasaları, Türev Piyasalar, SPK, İMKB, VOB	
2		Anlatım	Menkul kıymet kavramı, yatırım fonu, türev finansal araçlar	
3		Anlatım	Portföy tanımı, geleneksel portföy teorisi ve modern portföy teorisi	
4		Anlatım	Etkin piyasalar kuramı, temel analiz, teknik analiz	
5		Anlatım	Markowitz portföy teorisine giriş	
6		Anlatım	Portföy getirisinin ve riskinin ölçümü	
7		Anlatım	İki varlıktan bir portföy oluşturulması ve etkin sınırın oluşturulması	
8		Anlatım	İki varlıktan bir portföy oluşturulması ve etkin sınırın oluşturulması	
9		Anlatım	Sermaye varlıklarını fiyatlama modeline (SVFM) giriş	
10		Anlatım	SVFM ile varlıkların fiyatlandırılması	
11		Anlatım	Arbitraj fiyatlama modeli	
12		Anlatım	Portföy performansının değerlendirilmesi	
13		Anlatım	Aktif – Pasif portföy yönetimi	
14		Anlatım	Aktif – Pasif portföy yönetimi	

Aktiviteler	Sayısı	Süresi (saat)
Proje	0	0,00
Ara Sınav Hazırlık	1	15,00
Ders Sonrası Bireysel Çalışma	12	3,00
Derse Katılım	14	3,00
Uygulama / Pratik	0	0,00
Laboratuvar	0	0,00
Final Sınavı Hazırlık	1	30,00

Değerlendirme

Aktiviteler	Ağırlığı (%)
Vize	40,00
Kısa Sınav	0,00
Ödev	0,00
Derse Katılım	0,00
Uygulama / Pratik	0,00
Araştırma Sunumu	0,00
Final	60,00

	P.Ç. 1	P.Ç. 2	P.Ç. 3	P.Ç. 4	P.Ç. 5	P.Ç. 6	P.Ç. 7	P.Ç. 8	P.Ç. 9	P.Ç. 10
Ö.Ç. 1										
Ö.Ç. 2										
Ö.Ç. 3										
Ö.Ç. 4										
Ö.Ç. 5										

Tablo :

- P.Ç. 1 :** Uluslararası ticaretin ekonomik, hukuki ve sosyal dinamiklerini kapsayan kuramsal altyapıyı; ithalat, ihracat, ticaret politikaları, uluslararası anlaşmalar ve finansal süreçler çerçevesinde bütüncül bir yaklaşımla kavrar.
- P.Ç. 2 :** Lojistik süreçler ve tedarik zinciri yönetiminin temel ilkelerini, işleyiş mekanizmalarını ve operasyonel modellerini bütüncül bir yaklaşımla anlar; malzeme akışı, bilgi yönetimi ve değer zinciri süreçlerine ilişkin kuramsal bilgilere hakim olur.
- P.Ç. 3 :** Uluslararası ticaret ve lojistik süreçlerinde geçerli olan yasal düzenlemeleri, iş etiği kurallarını ve sürdürülebilirlik ilkelerini anlar, bu bilgiyi sorumlu bir şekilde uygulayabilmek için gerekli altyapıyı edinir.
- P.Ç. 4 :** Uluslararası ticaret ve lojistikte karşılaşılan karmaşık sorunları tanımlayarak, sebep-sonuç ilişkilerini analiz eder; süreçleri planlayarak yenilikçi ve etkili çözüm yolları geliştirir.
- P.Ç. 5 :** Alana ilişkin bilgileri ve güncel gelişmeleri çalışanlar ve ekip arkadaşlarıyla paylaşır; iş süreçlerinde bu bilgileri kullanarak stratejik planlar oluşturur ve uygulanabilir çözümler geliştirir.
- P.Ç. 6 :** Uluslararası ticaret ve lojistik süreçlerinde bilgi sistemlerini ve yazılımları etkin bir şekilde kullanır; analiz ettiği verilerle operasyonel ve stratejik kararlar alarak iş süreçlerini en iyi hale getirir.
- P.Ç. 7 :** İş etiği ilkelerine uygun kararlar alır, toplumsal değerlere duyarlılık gösterir ve sosyal sorumluluk projelerinde yer alarak çevre koruma, iş sağlığı ve güvenliği gibi konularda farkındalık geliştirir.
- P.Ç. 8 :** Bir yabancı dili en az Avrupa Dil Portföyü B1 Genel Düzeyinde kullanır, alanındaki bilgileri izler ve meslektaşları ile iletişim kurarak çok kültürlü ekiplerle işbirliği yapar, farklı kültürlerle etkili iletişim kurar ve uluslararası ticaret ile lojistik süreçlerinde paydaş ilişkilerini analiz ederek bu ilişkileri etkin bir şekilde yönetir.
- P.Ç. 9 :** Uluslararası ticaret ve lojistik projelerinde görev alır, sürdürülebilir yaklaşımlar benimser, kaynakları etkin kullanır, çevresel ve operasyonel riskleri analiz eder, yönetir ve çözüm önerileri sunar.
- P.Ç. 10 :** Kurum hedeflerine uygun şekilde eleştirel düşünme, sürekli öğrenme ve yeniliklere açık olma yaklaşımını benimser; ekip çalışmasına uyum sağlar, gerektiğinde liderlik yapar ve etkin iletişim becerileriyle iş süreçlerini geliştirir.
- Ö.Ç. 1 :** Finansal piyasalar ve yatırım araçları hakkında bilgi sahibi olur.
- Ö.Ç. 2 :** Portföy yatırımının nasıl yapıldığını yorumlar.
- Ö.Ç. 3 :** Finansal varlık türleri ve finansal kurumlar hakkında bilgi sahibi olur.
- Ö.Ç. 4 :** Portföy performansını hesaplar.
- Ö.Ç. 5 :** Portföy yönetimindeki riskler ve etkilerini açıklar.