

| Dersin Adı | Kodu | Yarıyılı | T+U | Kredisi | AKTS |
|--|--|--------------------|-----|---------|------|
| Menkul Kıymetler ve Portföy Yönetimi | 1006842 | 8 | 3+0 | 3 | 4 |
| Ön koşul Dersler | | | | | |
| Dersin Dili | Türkçe | | | | |
| Dersin Türü | Seçmeli | | | | |
| Dersin Koordinatörü | | | | | |
| Dersi Verenler | | | | | |
| Dersin Yardımcıları | | | | | |
| Dersin Amacı | Küreselleşen finansal pazarlar içinde sermaye pazarının önemi gittikçe artmaktadır. Bu bağlamda Türk Sermaye Pazarı ve sermaye pazarı analizleri önemli bir inceleme ve araştırma alanı oluşturmaktadır. Bu ders içinde sermaye pazarı analizi ve analiz yöntemleri ayrıntılı bir şekilde incelenmekte ve öğrencilere bu konuda gerekli bilgi aktarımının sağlanması amaçlanmaktadır. | | | | |
| Dersin Öğrenme Çıktıları | Bu dersin sonunda öğrenci; <ol style="list-style-type: none"> 1. Menkul değerler yönetiminin kuramsal temellerini kavrar. 2. Varlık dağıtımını anlar. 3. Tahvil değerlendirme ve yönetimi kavrar. 4. Pay senedi değerlendirme ve yönetimi konularını öğrenir. 5. Risk ve getiri hesabı yapar. 6. Türev finansal araçları öğrenir. | | | | |
| Dersin İçeriği | Finansal Piyasalar: Tanımı ve Önemi, İşlevleri, Sınıflandırılması, Menkul Değerler Yönetiminin Kuramsal Temelleri: Markowitz Portföy Kuramı, Sharpe Endeks Modeli, Finansal Varlıkları Fiyatlandırma Modeli (CAPM); Varlık Dağıtımı: Stratejik Varlık Dağıtımı, Taktiksel Varlık Dağıtımı; Tahvil Değerleme ve Yönetimi: Tahvil Değerleme Yöntemleri: Bugünkü Değer Yöntemi, Efektif Getiri Kavramı, Faiz Yapısı Eğrileri, Ortalama Bağlanma Süresi; Pay Senedi Değerleme ve Yönetimi: Pay Senedi Değerleme Yöntemleri, Teknik Analiz, Temel Analiz, Rassal Yürüyüş Yaklaşımı; Türevsel Araçlar. | | | | |
| Haftalar | Konular | | | | |
| 1 | Giriş | | | | |
| 2 | Finansal Sistemin Unsurları ve İşleyişi | | | | |
| 3 | Para Piyasası Araçları | | | | |
| 4 | Sermaye Piyasası Araçları (Hisse Senetleri) | | | | |
| 5 | Sermaye Piyasası Araçları (Tahviller) | | | | |
| 6 | Sermaye Piyasası Araçları (Diğer Araçlar) | | | | |
| 7 | Ara Sınav | | | | |
| 8 | Vadeli İşlemler Piyasası | | | | |
| 9 | Türev Finansal Araçlar (Forward, Futures, Options) | | | | |
| 10 | Finansal Kurumlar (TCMB ve Ticari Bankalar) | | | | |
| 11 | Finansal Kurumlar(Yatırım Bankası, Yatırım Ort ve diğ) | | | | |
| 12 | Finansal Kurumlar(BİST, SPK, BDDK) | | | | |
| 13 | Finansal Araçların Değerlemesi | | | | |
| 14 | Portföy Analizi | | | | |
| Genel Yeterlilikler | | | | | |
| Uluslararası finansal piyasaların işleyişini ve bu piyasalarda kullanılan finansal araçları, uluslararası ekonomik ve finansal kurumların işlevlerini öğrenerek uluslararası finansal işlemleri yapma kabiliyetine sahip olabilir. | | | | | |
| Kaynaklar | | | | | |
| Bolak, M. (1998). <i>Sermaye Piyasası Menkul Kıymetler ve Portföy Analizi</i> . İstanbul: Beta Basım Yayın | | | | | |
| Fettahoğlu, A. (1993). <i>Sermaye Piyasası ve Analiz Yöntemleri-I</i> . Trabzon: Karadeniz Teknik Üniversitesi İktisadi ve İdari Bilimler Fakültesi Yayınları | | | | | |
| Değerlendirme Sistemi | | | | | |
| Ara sınav: % 40 | | Final: % 60 | | | |

| PROGRAM ÖĞRENME ÇIKTILARI İLE DERS ÖĞRENİM KAZANIMLARI İLİŞKİSİ TABLOSU | | | | | | | | | | | | | | | |
|--|-------------|---------|---------|---------|---------|---------|---------|---------|---------|----------|----------|----------|--------------|-------|-------|
| | 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 |
| ÖK1 | 5 | 4 | 5 | 5 | 4 | 4 | 4 | 3 | 1 | 1 | 1 | 1 | 1 | 3 | 4 |
| ÖK2 | 5 | 2 | 3 | 4 | 4 | 2 | 2 | 1 | 1 | 1 | 1 | 1 | 1 | 2 | 4 |
| ÖK3 | 5 | 4 | 5 | 4 | 4 | 3 | 4 | 2 | 1 | 1 | 1 | 1 | 1 | 2 | 4 |
| ÖK4 | 5 | 4 | 5 | 4 | 4 | 3 | 4 | 2 | 1 | 1 | 1 | 1 | 1 | 2 | 4 |
| ÖK5 | 4 | 4 | 4 | 3 | 3 | 3 | 4 | 3 | 1 | 1 | 1 | 1 | 1 | 3 | 5 |
| ÖK6 | 5 | 4 | 4 | 4 | 5 | 3 | 2 | 2 | 1 | 1 | 1 | 1 | 1 | 2 | 4 |
| ÖK: Öğrenme Kazanımları PÇ: Program Çıktıları | | | | | | | | | | | | | | | |
| Katkı Düzeyi | 1 Çok Düşük | | | 2 Düşük | | | 3 Orta | | | 4 Yüksek | | | 5 Çok Yüksek | | |

Program Çıktıları ve İlgili Dersin İlişkisi

| Dersin Adı | 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 |
|---|---------|---------|---------|---------|---------|---------|---------|---------|---------|----------|----------|----------|----------|----------|----------|
| Menkul Kıymetler ve Portföy Yönetimi | 5 | 4 | 4 | 4 | 4 | 3 | 3 | 2 | 1 | 1 | 1 | 1 | 1 | 2 | 4 |