

Dersin Adı	Kodu	Yarıyılı	T+U	Kredisi	AKTS
Menkul Kıymetler ve Portföy Yönetimi	1009728	7	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 Endeksi 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