



İKTİSADİ İDARİ VE SOSYAL BİLİMLER FAKÜLTESİ
İŞLETME BÖLÜMÜ
YATIRIM PROJELERİ ANALİZİ VE PORTFÖY YÖNETİMİ DERS BİLGİ
FORMU

Dersin Adı	Kodu	Yarıyıl	T+U (saat/hafta)	Kredi	AKTS
Yatırım Projeleri Analizi	İŞL 330	3	2 + 0	2	3

Akademik Birim	İşletme
Ön-Koşul Dersleri	Ön Koşul Yoktur.
Dersin Türü ve Düzeyi	Seçmeli
Dersin Dili	Türkçe
Yılı ve Dönemi	Bahar
Zamanı ve Yeri	
Dersin Amacı	Dersin amacı, öğrencilerin modern portföy teorisinin esaslarını, varlık seçim kriterlerini, farklı menkul değerleri değerlendirmede kullanılan analiz tekniklerini kavramalarını sağlamaktır. Bu alanda piyasa profesyonelleri öğrencilerle buluşarak gerçek dünyada nasıl yatırım yapılacağına ilişkin derse katkıda bulunacaktır.
Dersin İçeriği	Finansal Risk Kavramı ve Riskin Ölçülmesi, Finansal Varlık Getirilerinin Korelasyon Yapısı, Faktor Modelleri ve APT, Etkin Piyasa Hipotezi, Risk Sermayesi ve Riske Maruz Değer Uygulamaları, Yatırım Süreçlerinin Değerlendirilmesi
Dersin Öğrenme Çıktıları	Dersin başarıyla tamamlanması, gerekli okuma ve faaliyetlerin yapılmış olması durumunda öğrenciler şu yetkinliklere sahip olacaklar: ÖÇ1. Öğrenciler, finansal varlık analizi konusu hakkında bilgi sahibi olurlar; ÖÇ2. finansal risk kavramı ve riskin ölçülmesi yöntem ve tekniklerini öğrenirler; ÖÇ3. portföy kuramı hakkında bilgi sahibi olurlar; ÖÇ4. finansal varlık analiz yöntem ve tekniklerini öğrenirler; ÖÇ5. yatırım stratejileri hakkında bilgi sahibi olurlar.
Dersin Kuralları	1. Derse devam %70 oranında (ara sınav haftası hariç 9 hafta) zorunludur. Yoklamalar her hafta dersten sonra sisteme girilir; daha sonra değiştirme imkânı yoktur. 2. Öğrenciler derse en fazla 10 dakika geç kalabilirler; ancak bu alışkanlık haline getirilemez. Dersin ilk bölümüne katılamayanlar ikinci bölüme mutlaka katılmalıdırlar; bu devamsızlığın hesaplanmasında önemlidir. 3. Bu formda derste kaynak olarak kullanılabilecek kitaplar belirtilmiştir. Öğrenciler bu formda belirtilen 14 haftalık konulardan ve ayrıca derste anlatılanlardan sorumludurlar. 4. Öğrenciler her hafta anlatılacak konulara önceden hazırlanırlar; kendilerine konu hakkında soru sorulduğunda makul düzeyde bilmeleri beklenir. 5. Öğrenciler derslere gerekli malzemeleri (kitap, defter ve kalem) getirirler; derste kendi aralarında sohbet edemezler. 6. Derste cep telefonları sessiz konumda olur. Ders esnasında bütün



İKTİSADİ İDARİ VE SOSYAL BİLİMLER FAKÜLTESİ
İŞLETME BÖLÜMÜ
YATIRIM PROJELERİ ANALİZİ VE PORTFÖY YÖNETİMİ DERS BİLGİ
FORMU

	öğrencilerimiz dersle meşgul olurlar. Derste, su dışında herhangi bir yiyecek ve içecek tüketilemez. 7. Ödevler/görevler zamanında yapılır ve teslim edilir. Ödevlerin teslim tarihleri derste duyurulur. 8. Ödevler derste durulan formatta hazırlanır ve intihal oranı azami %30 olabilir. %30 intihal oranı % 30'dan yüksek olan ödevler değerlendirmeye alınmaz.
Dersin Öğrenme Yöntem ve Teknikleri	Ders anlatım Tartışma Örnek Olay

ÖĞRETİM ÜYESİ

Öğretim Üyesi	
Ofis Saatleri	Salı:12.00-13.00
E-Posta	
Ders Asistanı	
E-Posta	

HAFTALIK PROGRAM

Hafta	Konular	Ön Hazırlık (Okumalar)	Öğrenim Çıktısı
1.	Risk Kavramı ve Riskin Ölçülmesi	Ders kitabında ilgili bölüm	ÖÇ2
2.	Finansal Varlık Getirilerinin Korelasyon Yapısı	Ders kitabında ilgili bölüm	ÖÇ1
3.	Optimum Portföy Seçimi	Ders kitabında ilgili bölüm	ÖÇ3
4.	Beklenen Getirinin Hesaplanması	Ders kitabında ilgili bölüm	ÖÇ4
5.	Finansal Varlıkları Değerleme Modeli	Ders kitabında ilgili bölüm	ÖÇ4
6.	Faktor Modelleri ve APT	Ders kitabında ilgili bölüm	ÖÇ3, ÖÇ4
7.	Finansal Varlık Analizleri	Ders kitabında ilgili bölüm	ÖÇ5
8.	ARA SINAV HAFTASI	ARA SINAV HAFTASI	SINAV HAFTASI
9.	Risk Sermayesi, Riske Maruz Değer Uygulamalar, ESG Riski	Ders kitabında ilgili bölüm	ÖÇ5
10.	Uluslararası Çeşitlendirme	Ders kitabında ilgili bölüm	ÖÇ5
11.	Etkin Piyasalar Teorisi	Ders kitabında ilgili bölüm	ÖÇ4



İKTİSADİ İDARİ VE SOSYAL BİLİMLER FAKÜLTESİ
İŞLETME BÖLÜMÜ
YATIRIM PROJELERİ ANALİZİ VE PORTFÖY YÖNETİMİ DERS BİLGİ
FORMU

12.	Faiz ve Vade Yapısı Teorileri	Ders kitabında ilgili bölüm	ÖÇ3
13.	Davranışsal Finans ve Varlık Fiyatlarına Etkisi	Ders kitabında ilgili bölüm	ÖÇ4
14.	Teknik Analiz	Ders kitabında ilgili bölüm	ÖÇ5
	Ödev sunumları		

ZORUNLU VE ÖNERİLEN OKUMALAR

Menkul Değer Yatırımlarına Giriş, Dr. Arman Tevfik ve Dr. Gürman Tevfik, Ekonomik Araştırmalar Merkezi Yayınları, İstanbul, 1999.

Michael McMillan, Jerald E. Pinto, Wendy L. Pirie, Gerhard Van de Venter, Lawrence E. Kochard. 2011. Investments: Principles of Portfolio and Equity Analysis. Wiley Edition

DEĞERLENDİRME SİSTEMİ

Faaliyet Türleri	Adet	Katkı Payı
Derse Devam		
Uygulama		
Saha Çalışması		
Staj		
Kısa Sınavlar		
Ödev-Makale	1	10
Sunum		
Sınıf İçi Performans		
Projeler		
Seminer		
Ara Sınavlar	1	30
Final Sınavı	1	60
Toplam		100

AKTS/İŞ YÜKÜ HESAPLAMASI



İKTİSADİ İDARİ VE SOSYAL BİLİMLER FAKÜLTESİ
İŞLETME BÖLÜMÜ
YATIRIM PROJELERİ ANALIZI VE PORTFÖY YÖNETİMİ DERS BİLGİ
FORMU

Etkinlikler	Sayısı	Süresi (Saat)	Toplam İş Yüğü
Derse Devam	15	2	30
Uygulama			
Saha Çalışması			
Staj			
Kısa Sınavlar			
Ödev-Makale	1	10	10
Sunum			
Sınıf İçi Performans			
Projeler			
Seminer			
Ara Sınavlar	1	20	20
Final Sınavı	1	25	25
Toplam İş Yüğü			85
Toplam İş Yüğü / 30 saat			2,83
Dersin AKTS Kredisi			3

PROGRAM YETERLİKLERİ VE ÖĞRENİM ÇIKTILARI İLİŞKİSİ

Öğrenme çıktıları, program yeterliklerinin karşılandığının göstergesidir. Her çıktı en az bir program yeterliğine denk gelmelidir.

Öğrenme çıktıları ile program yeterlilikleri arasındaki ilişkinin gücünü aşağıdaki gibi rakamla ifade ediniz:

- 1= çok zayıf ilişki
- 2= zayıf ilişki
- 3= ilişkili
- 4= güçlü ilişki
- 5= çok güçlü ilişki



İKTİSADİ İDARİ VE SOSYAL BİLİMLER FAKÜLTESİ
İŞLETME BÖLÜMÜ
YATIRIM PROJELERİ ANALIZI VE PORTFÖY YÖNETİMİ DERS BİLGİ
FORMU

	PÖÇ1	PÖÇ2	PÖÇ3	PÖÇ4	PÖÇ5	PÖÇ6	PÖÇ7	PÖÇ8
ÖÇ1	1	2	2	5	4	3	3	3
ÖÇ2	1	2	2	5	4	3	5	3
ÖÇ3	1	2	2	4	3	3	3	3
ÖÇ4	1	2	2	4	2	2	2	2
ÖÇ5	1	2	2	4	2	2	4	2