



## YOZGAT BOZOK ÜNİVERSİTESİ YOZGAT MESLEK YÜKSEKOKULU

### FINANS, BANKACILIK VE SİGORTACILIK PROGRAMI YATIRIM ANALİZİ VE PORTFÖY

#### YÖNETİMİ DERS ÖĞRETİM PLANI

| Dersin Kodu | Dersin Adı                          | Yarıyıl | Dersin Türü (Z/S) | T+U+L (Saat/Hafta) | Kredi | AKTS | Eğitim Dili |
|-------------|-------------------------------------|---------|-------------------|--------------------|-------|------|-------------|
| BNK726      | Yatırım Analizi ve Portföy Yönetimi |         | Seçmeli           | 2+1+0              | 3     | 3    | Türkçe      |

#### DERS BİLGİLERİ

|                                         |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                           |
|-----------------------------------------|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| <b>Dersin Katalog Tanımı (İçeriği)</b>  | Yatırım ortamı ve piyasanın oyuncuları; menkul kıymet borsaları-Türkiye’de sermaye piyasası faaliyetleri, faiz oranları, paranın zaman değeri; portföy risk ve getirisi; portföy seçimi; sermaye varlıklarını fiyatlama modeli (SVFM); faktör modelleri; arbitraj fiyatlama teorisi; etkin piyasalar hipotezi ve anomaliler; hisse senetleri ve İMKB hisse senedi piyasasında alım satım işlemleri; hisse senetlerinin değerlendirilmesi; tahviller, temel analiz; teknik analiz; portföy yönetim stratejileri; vadeli işlem sözleşmeleri; opsiyon sözleşmeleri ve opsiyon değerlendirilmesi.                             |
| <b>Dersin Amacı</b>                     | Modern portföy yönetimi ve uygulamaları hakkında öğrencileri bilgi sahibi kılarak, bu konularda öğrencilerin yorum ve analiz yeteneğinin geliştirilmesi.                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                  |
| <b>Dersin Seviyesi</b>                  | Lisans                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                    |
| <b>Dersin Öğretim Dili</b>              | Türkçe                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                    |
| <b>Öğretim Yöntemi</b>                  | ( X ) Örgün ( ) Uzaktan ( ) Karma/Hibrit                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                  |
| <b>Dersi Yürüten Öğretim Elemanları</b> |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                           |
| <b>Dersin Ön Koşulu Ders(ler)i</b>      | Bu dersin herhangi bir ön koşulu bulunmamaktadır.                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                         |
| <b>Dersin Öğrenme Çıktıları</b>         | <ol style="list-style-type: none"><li>1. Para ve sermaye piyasası arasındaki farkı, endeks hesaplarını ve türev piyasası araçlarını açıkça açıklayabilecek</li><li>2. Menkul kıymet piyasalarında halka arzın nasıl yapıldığını, hisse senetlerinin nasıl işlem gördüğünü ve açığa satışın nasıl yapıldığını açıklayabilecek</li><li>3. Finansal varlıklarıda getiri ve risk kavramları hakkında bilgi verebilecek</li><li>4. Finansal piyasalarda işlem gören menkul kıymetler ve değerlendirilmesi hakkında bilgi sahibi olabilecek</li><li>5. Portföy teorisi ve risk azaltımı stratejilerini kavrayabilecek</li></ol> |

#### DERS İÇERİĞİ

| Hafta | Teori                                           | Uygulama/Laboratuvar |
|-------|-------------------------------------------------|----------------------|
| 1     | Reel Ve Finansal Varlıklar                      |                      |
| 2     | Finansal Piyasalar ve Ekonomi Piyasa Oyuncuları |                      |
| 3     | Varlık Çeşitleri ve Finansal Enstrümanlar       |                      |
| 4     | Menkul Kıymet Piyasaları                        |                      |
| 5     | Risk ve Getiri                                  |                      |
| 6     | Etkin Varlık Çeşitlendirmesi                    |                      |

|    |                                                                         |  |
|----|-------------------------------------------------------------------------|--|
| 7  | Geleneksel Portföy Yaklaşımı                                            |  |
| 8  | Vize Sınavı                                                             |  |
| 9  | Sermaye Varlıklarını Fiyatlandırma Modeli ve Arbitraj Fiyatlama Teorisi |  |
| 10 | Markowitz Portföy Kuramı                                                |  |
| 11 | Arbitraj Fiyatlama Kuramı                                               |  |
| 12 | Portföy Performansının Ölçülmesi                                        |  |
| 13 | Portföy Yönetim Stratejileri                                            |  |
| 14 | Uluslararası Portföy Yönetimi                                           |  |
|    | Final Sınavı                                                            |  |

### Dersin Öğrenme Kaynakları

1. Borsada Uygulamalı Portföy Yönetimi, Ali CEYLAN - Turhan KORKMAZ

### DEĞERLENDİRME ÖLÇÜTLERİ

| Dönem İçi Çalışma Etkinlikleri                   | Sayısı | Katkısı |
|--------------------------------------------------|--------|---------|
| Ödev                                             |        |         |
| Uygulama                                         |        |         |
| Forum/ Tartışma Uygulaması                       |        |         |
| Kısa sınav (Quiz)                                | 1      | %50     |
| Vize Sınavı                                      | 1      | %50     |
| Dönemiçi Çalışmaların Yarıyıl Başarıya Oranı (%) |        | %40     |
| Finalin Başarıya Oranı (%)                       | 1      | %60     |
| Toplam                                           |        | %100    |

### DERS İŞ YÜKÜ TABLOSU

| Etkinlik                               | Toplam Hafta Sayısı | Süre (Haftalık Saat) | Toplam İş Yüğü |
|----------------------------------------|---------------------|----------------------|----------------|
| Teori                                  | 14                  | 3                    | 42             |
| Uygulama                               |                     |                      |                |
| Forum/ Tartışma Uygulaması             | 14                  | 1                    | 14             |
| Okuma                                  |                     |                      |                |
| İnternet Taraması, Kütüphane Çalışması |                     |                      |                |
| Materyal Tasarlama, Uygulama           |                     |                      |                |
| Rapor Hazırlama                        |                     |                      |                |
| Sunu Hazırlama                         |                     |                      |                |
| Sunum                                  |                     |                      |                |
| Final Sınavı                           | 1                   | 1                    | 1              |
| Final Sınavına Hazırlık                | 1                   | 10                   | 10             |
| Diğer (Belirtiniz: ... ..)             |                     |                      |                |
| Toplam İş Yüğü                         |                     |                      | 91             |
| Toplam İş Yüğü / 25 (s)                |                     |                      | 71/25          |
| Dersin AKTS Kredisi                    |                     |                      | 2,84=4         |

Not: Dersin iş yükü tablosu öğretim elemanı tarafından ders özelinde belirlenecektir.

### PROGRAM ÖĞRENME ÇIKTILARI KATKI DÜZEYLERİ

| No | Program Öğrenme Çıktıları                                                                                                                                                             | 1 | 2 | 3 | 4 | 5 |
|----|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|---|---|---|---|---|
| 1  | Bankacılık ve Sigortacılık alanında yeterli altyapıya sahiptir; bu alanlardaki kuramsal ve uygulamalı bilgileri kullanır.                                                             |   |   | X |   |   |
| 2  | Alanı ile ilgili temel düzeydeki bir çalışmayı bağımsız olarak yürütebilme becerisine sahiptir.                                                                                       |   |   | X |   |   |
| 3  | Alanında edindiği temel düzeydeki bilgi ve becerileri kullanarak, sorunları tanımlar, analiz eder ve verileri yorumlar.                                                               |   |   | X |   |   |
| 4  | Alanı ile ilgili uygulamalarda, takımlarda veya bireysel çalışmalarda sorumluluk alır.                                                                                                |   |   | X |   |   |
| 5  | Alanı ile ilgili mesleki ortam ve araçları kullanarak, plan ve proje gerçekleştirme becerisine sahiptir.                                                                              |   |   |   | X |   |
| 6  | Öğrenimini aynı alanda bir ileri eğitim düzeyine veya aynı düzeydeki bir mesleğe yönlendirebilir.                                                                                     |   |   | X |   |   |
| 7  | Sorumluluğu altında çalışanların bir proje çerçevesinde gelişimlerine yönelik etkinlikleri yürütebilme becerisine sahiptir.                                                           |   | X |   |   |   |
| 8  | Alanının gerektirdiği temel düzeyde bilgisayar yazılım ve donanımlarını kullanır.                                                                                                     | X |   |   |   |   |
| 9  | Alanı ile ilgili iş yeri uygulamaları, çalışanların sağlığı, çevre ve iş güvenliği konularında bilgiye ve alanındaki uygulamaların hukuksal sonuçları hakkında farkındalığa sahiptir. | X |   |   |   |   |
| 10 | Alanı ile ilgili konularda düşüncelerini ve sorunlara ilişkin çözüm önerilerini uzman olan ve olmayan kişilerle paylaşabilir ve tartışabilir.                                         |   |   |   | X |   |
| 11 | Tarihi değerlere saygılı, sosyal sorumluluk bilincine, evrensel, toplumsal ve mesleki etik bilincine sahiptir.                                                                        |   |   | X |   |   |
| 12 | Sözlü ve yazılı olarak etkili iletişim kurar.                                                                                                                                         |   |   |   | X |   |
| 13 | Alanındaki yenilikleri takip edebilecek düzeyde bir yabancı dil bilgisine sahiptir.                                                                                                   | X |   |   |   |   |
| 14 | Yaşam boyu öğrenmenin gerekliliğini kavrar, bilim ve teknolojiye gelişmeleri izler ve bilgilerin güncelliğini sağlayacak yöntemleri kullanır.                                         |   |   |   | X |   |
| 15 | Sosyal hakların evrenselliği, sosyal adalet, kalite ve kültürel değerler ile çevre koruma konularında farkındalığa sahiptir.                                                          |   |   |   | X |   |