

## GENEL TANIM / GENERAL DESCRIPTION

|                                                                                   |                                                                                                                                                                                                                                                            |                                                                                                                                                                                                                                                            |
|-----------------------------------------------------------------------------------|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| Ders Adı / Course Name                                                            | Investment Analysis and Portfolio Management / Investment Analysis and Portfolio Management                                                                                                                                                                |                                                                                                                                                                                                                                                            |
| Ders Kodu / Course Code                                                           | SPK301A                                                                                                                                                                                                                                                    |                                                                                                                                                                                                                                                            |
| Ders Türü / Course Type                                                           |                                                                                                                                                                                                                                                            |                                                                                                                                                                                                                                                            |
| Ders Seviyesi / Course Level                                                      | Bachelor / Bachelor                                                                                                                                                                                                                                        |                                                                                                                                                                                                                                                            |
| Ders Akts Kredi / ECTS                                                            | 6.00                                                                                                                                                                                                                                                       |                                                                                                                                                                                                                                                            |
| Haftalık Ders Saati (Kuramsal) / Course Hours For Week (Theoretical)              | 3.00                                                                                                                                                                                                                                                       |                                                                                                                                                                                                                                                            |
| Haftalık Uygulama Saati / Course Hours For Week (Objected)                        | 0.00                                                                                                                                                                                                                                                       |                                                                                                                                                                                                                                                            |
| Haftalık Laboratuar Saati / Course Hours For Week (Laboratory)                    | 0.00                                                                                                                                                                                                                                                       |                                                                                                                                                                                                                                                            |
| Dersin Verildiği Yıl / Year                                                       | 3                                                                                                                                                                                                                                                          |                                                                                                                                                                                                                                                            |
| Öğretim Sistemi / Teaching System                                                 | Daytime Class / Daytime Class                                                                                                                                                                                                                              |                                                                                                                                                                                                                                                            |
| Eğitim Dili / Education Language                                                  | Turkish / Turkish                                                                                                                                                                                                                                          |                                                                                                                                                                                                                                                            |
| Ön Koşulu Olan Ders(ler) / Precondition Courses                                   | Ön koşul olan ders yoktur.                                                                                                                                                                                                                                 | There is no prerequisite course.                                                                                                                                                                                                                           |
| Amacı / Purpose                                                                   | Bu dersi tamamlayan öğrenciler yatırım araçlarını tanıyacak, finansal varlık değerlemesi ve yatırım analizi yapabilecek ve yatırım kararları verebilecek bilgi seviyesine ulaşacaktır.                                                                     | Students who complete this course will have the knowledge level to recognize investment instruments, make financial asset valuation, investment analysis.                                                                                                  |
| İçeriği / Content                                                                 | Bu derste, finansal piyasalar genel olarak tanıtıldıktan sonra, işlem gören ürünler incelenecek, finansal varlık yatırımların risk ve getiri değerlendirmesi yapılacak, portföy oluşturma ve yönetimi konuları işlenecektir.                               | In this course, after introducing the financial markets in general, the traded products will be examined, the risk and return assessment of financial asset investments will be made, portfolio creation and management issues will be covered.            |
| Önerilen Diğer Hususlar / Recommended Other Considerations                        |                                                                                                                                                                                                                                                            |                                                                                                                                                                                                                                                            |
| Staj Durumu / Internship Status                                                   |                                                                                                                                                                                                                                                            |                                                                                                                                                                                                                                                            |
| Kitabı / Malzemesi / Önerilen Kaynaklar / Books / Materials / Recommended Reading | Yatırım Analizi ve Portföy Yönetimi (Prof. Dr. Mehmet Baha KARAN)<br>Sermaye Piyasası ve Yatırım Analizi (Doç. Dr. Adem ANBAR, Prof. Dr. Lale KARABIYIK)<br>Sermaye Piyasası Yatırım Araçları ve Analizi (Prof. Dr. Ahmet AKSOY, Doç. Dr. Cihan TANRIÖVEN) | Yatırım Analizi ve Portföy Yönetimi (Prof. Dr. Mehmet Baha KARAN)<br>Sermaye Piyasası ve Yatırım Analizi (Doç. Dr. Adem ANBAR, Prof. Dr. Lale KARABIYIK)<br>Sermaye Piyasası Yatırım Araçları ve Analizi (Prof. Dr. Ahmet AKSOY, Doç. Dr. Cihan TANRIÖVEN) |
| Öğretim Üyesi (Üyeleri) / Faculty Member (Members)                                | Dr. Öğretim Üyesi Taşkın Subaşı                                                                                                                                                                                                                            |                                                                                                                                                                                                                                                            |

## ÖĞRENME ÇIKTILARI / LEARNING OUTCOMES

|   |                                                                                                                                                   |                                                                                                                                               |
|---|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 1 | Yatırım analizi ve portföy yönetiminde kullanılan teknik ve metodlar ile, bunların temelinde yatan teori ve kavramlar hakkında bilgi sahibi olur. | Have knowledge about the techniques and methods used in investment analysis and portfolio management, and the underlying theory and concepts. |
| 2 | Yatırım kararlarını analiz etme yetkinliğine ulaşır.                                                                                              | Reaches the competence to analyze investment decisions.                                                                                       |
| 3 | Yatırım araçlarını, yatırım ortamını ve piyasaları tanır.                                                                                         | Know investment tools, investment environment and markets.                                                                                    |
| 4 | Değişik finansal varlıkların değerlemesini yapabilir.                                                                                             | Can make the valuation of different financial assets.                                                                                         |
| 5 | Portföy yönetimi teorilerini ve süreçlerini kavrar.                                                                                               | Understands portfolio management theories and processes.                                                                                      |
| 6 | Portföy yönetiminde risk getiri analizi yapabilir.                                                                                                | Can make risk return analysis in portfolio management.                                                                                        |

## HAFTALIK DERS İÇERİĞİ / DETAILED COURSE OUTLINE

| Hafta / Week |                                                              |          |     |                                                          |                           |
|--------------|--------------------------------------------------------------|----------|-----|----------------------------------------------------------|---------------------------|
| 1            | Teorik Dersler / Theoretical                                 | Uygulama | Lab | Öğretim Yöntem ve Teknikleri/Teaching Methods Techniques | Ön Hazırlık / Preliminary |
|              | Yatırım Kavramı ve Yatırım Süreci                            |          |     |                                                          |                           |
|              | Investment Concept and Investment Process                    |          |     |                                                          |                           |
| 2            | Teorik Dersler / Theoretical                                 | Uygulama | Lab | Öğretim Yöntem ve Teknikleri/Teaching Methods Techniques | Ön Hazırlık / Preliminary |
|              | Finansal Sistem ve Finansal Varlıklara Yatırım               |          |     |                                                          |                           |
|              | Financial System and Investing in Financial Assets           |          |     |                                                          |                           |
| 3            | Teorik Dersler / Theoretical                                 | Uygulama | Lab | Öğretim Yöntem ve Teknikleri/Teaching Methods Techniques | Ön Hazırlık / Preliminary |
|              | Finansal Varlıklarda Getiri ve Riskin Ölçülmesi              |          |     |                                                          |                           |
|              | Measuring Return and Risk in Financial Assets                |          |     |                                                          |                           |
| 4            | Teorik Dersler / Theoretical                                 | Uygulama | Lab | Öğretim Yöntem ve Teknikleri/Teaching Methods Techniques | Ön Hazırlık / Preliminary |
|              | Pay Senedinin Özellikleri ve Pay Senedi Yatırımı             |          |     |                                                          |                           |
|              | Features of Shares and Stock Investment                      |          |     |                                                          |                           |
| 5            | Teorik Dersler / Theoretical                                 | Uygulama | Lab | Öğretim Yöntem ve Teknikleri/Teaching Methods Techniques | Ön Hazırlık / Preliminary |
|              | Pay Senedi Değerlemesi ve Borsa İstanbul Pay Senedi Piyasası |          |     |                                                          |                           |
|              | Stock Valuation and Borsa Istanbul Equity Market             |          |     |                                                          |                           |

|    |                                                                    |          |     |                                                          |                           |
|----|--------------------------------------------------------------------|----------|-----|----------------------------------------------------------|---------------------------|
| 6  | Teorik Dersler / Theoretical                                       | Uygulama | Lab | Öğretim Yöntem ve Teknikleri/Teaching Methods Techniques | Ön Hazırlık / Preliminary |
|    | Temel Analiz                                                       |          |     |                                                          |                           |
|    | Financial Analysis                                                 |          |     |                                                          |                           |
| 7  | Teorik Dersler / Theoretical                                       | Uygulama | Lab | Öğretim Yöntem ve Teknikleri/Teaching Methods Techniques | Ön Hazırlık / Preliminary |
|    | Teknik Analiz                                                      |          |     |                                                          |                           |
|    | Technical analysis                                                 |          |     |                                                          |                           |
| 8  | Teorik Dersler / Theoretical                                       | Uygulama | Lab | Öğretim Yöntem ve Teknikleri/Teaching Methods Techniques | Ön Hazırlık / Preliminary |
|    | Ara Sınav                                                          |          |     |                                                          |                           |
|    | Midterm                                                            |          |     |                                                          |                           |
| 9  | Teorik Dersler / Theoretical                                       | Uygulama | Lab | Öğretim Yöntem ve Teknikleri/Teaching Methods Techniques | Ön Hazırlık / Preliminary |
|    | Finans Matematiği, Paranın Zaman Değeri Kavramı                    |          |     |                                                          |                           |
|    | Financial Mathematics, Time Value of Money Concept                 |          |     |                                                          |                           |
| 10 | Teorik Dersler / Theoretical                                       | Uygulama | Lab | Öğretim Yöntem ve Teknikleri/Teaching Methods Techniques | Ön Hazırlık / Preliminary |
|    | Tahvil ve Bono Çeşitleri, Sahibine Sağladığı Haklar                |          |     |                                                          |                           |
|    | Types of Bonds and Bills, Rights Provided to the Owner             |          |     |                                                          |                           |
| 11 | Teorik Dersler / Theoretical                                       | Uygulama | Lab | Öğretim Yöntem ve Teknikleri/Teaching Methods Techniques | Ön Hazırlık / Preliminary |
|    | Tahvil değerlendirme ve Borsa İstanbul Borçlanma Araçları Piyasası |          |     |                                                          |                           |
|    | Bond valuation and Borsa İstanbul Debt Securities Market           |          |     |                                                          |                           |

|    |                                                                                                                  |          |     |                                                          |                           |
|----|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|----------|-----|----------------------------------------------------------|---------------------------|
| 12 | Teorik Dersler / Theoretical                                                                                     | Uygulama | Lab | Öğretim Yöntem ve Teknikleri/Teaching Methods Techniques | Ön Hazırlık / Preliminary |
|    | Diğer Sermaye Piyasası Araçlarına Yatırım : Varant, Yatırım Fonu, Kira Sertifikası, Varlığa Dayalı Menkul Kıymet |          |     |                                                          |                           |
|    | Investing in Other Capital Market Instruments: Warrant, Mutual Fund, Lease Certificate, Asset Backed Securities  |          |     |                                                          |                           |
| 13 | Teorik Dersler / Theoretical                                                                                     | Uygulama | Lab | Öğretim Yöntem ve Teknikleri/Teaching Methods Techniques | Ön Hazırlık / Preliminary |
|    | Portföy Analizi                                                                                                  |          |     |                                                          |                           |
|    | Portfolio Analysis                                                                                               |          |     |                                                          |                           |
| 14 | Teorik Dersler / Theoretical                                                                                     | Uygulama | Lab | Öğretim Yöntem ve Teknikleri/Teaching Methods Techniques | Ön Hazırlık / Preliminary |
|    | Portföy Performansının Değerlendirilmesi                                                                         |          |     |                                                          |                           |
|    | Assessing Portfolio Performance                                                                                  |          |     |                                                          |                           |

## DEĞERLENDİRME / EVALUATION

| Yarıyıl (Yıl) İçi Etkinlikleri / Term (or Year) Learning Activities | Sayı / Number | Katkı Yüzdesi / Percentage of Contribution (%) |
|---------------------------------------------------------------------|---------------|------------------------------------------------|
| Ara Sınav / Midterm Examination                                     | 1             | 100                                            |
| Toplam / Total:                                                     | 1             | 100                                            |
| Başarı Notuna Katkı Yüzdesi / Contribution to Success Grade(%):     |               | 40                                             |

  

| Yarıyıl (Yıl) Sonu Etkinlikleri / End Of Term (or Year) Learning Activities | Sayı / Number | Katkı Yüzdesi / Percentage of Contribution (%) |
|-----------------------------------------------------------------------------|---------------|------------------------------------------------|
| Final Sınavı / Final Examination                                            | 1             | 100                                            |
| Toplam / Total:                                                             | 1             | 100                                            |
| Başarı Notuna Katkı Yüzdesi / Contribution to Success Grade(%):             |               | 60                                             |

  

|                                                                                                                 |     |
|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------|-----|
| Etkinliklerinin Başarı Notuna Katkı Yüzdesi(%) Toplamı / Total Percentage of Contribution (%) to Success Grade: | 100 |
| Değerlendirme Tipi / Evaluation Type:                                                                           |     |

## İŞ YÜKÜ / WORKLOADS

| Etkinlikler / Workloads                                                                                                                                                              | Sayı / Number | Süresi (Saat) / Duration (Hours) | Toplam İş Yüğü (Saat) / Total Work Load (Hour) |
|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|---------------|----------------------------------|------------------------------------------------|
| Ara Sınav / Midterm Examination                                                                                                                                                      | 1             | 1.00                             | 1.00                                           |
| Ara Sınav İçin Bireysel Çalışma / Individual Study for Mid term Examination                                                                                                          | 6             | 8.00                             | 48.00                                          |
| Derse Katılım / Attending Lectures                                                                                                                                                   | 13            | 2.00                             | 26.00                                          |
| Final Sınavı / Final Examination                                                                                                                                                     | 1             | 1.00                             | 1.00                                           |
| Final Sınavı için Bireysel Çalışma / Individual Study for Final Examination                                                                                                          | 6             | 8.00                             | 48.00                                          |
| Okuma / Reading                                                                                                                                                                      | 5             | 5.00                             | 25.00                                          |
| Toplam / Total:                                                                                                                                                                      | 32            | 25.00                            | 149.00                                         |
| Dersin AKTS Kredisi = Toplam İş Yüğü (Saat) / 25.00 (Saat/AKTS) = 149.00/25.00 = 5.96 ~ / Course ECTS Credit = Total Workload (Hour) / 25.00 (Hour / ECTS) = 149.00 / 25.00 = 5.96 ~ |               |                                  |                                                |

PROGRAM VE ÖĞRENME ÇIKTISI / PROGRAM LEARNING OUTCOMES

| Öğrenme Çıktıları / Learning Outcomes                                                                                                                                                                                                                                                               | Program Çıktıları / Program Outcomes |       |       |       |       |       |       |       |       |        |
|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|--------------------------------------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|--------|
|                                                                                                                                                                                                                                                                                                     | 1.1.1                                | 1.1.2 | 1.1.3 | 1.1.4 | 1.1.5 | 1.1.6 | 1.1.7 | 1.1.8 | 1.1.9 | 1.1.10 |
| 1.Yatırım analizi ve portföy yönetiminde kullanılan teknik ve metodlar ile, bunların temelinde yatan teori ve kavramlar hakkında bilgi sahibi olur. / Have knowledge about the techniques and methods used in investment analysis and portfolio management, and the underlying theory and concepts. | 5                                    | 5     | 2     | 3     | 3     | 3     | 3     | 3     | 1     | 1      |
| 2.Yatırım kararlarını analiz etme yetkinliğine ulaşır. / Reaches the competence to analyze investment decisions.                                                                                                                                                                                    | 5                                    | 4     | 3     | 1     | 3     |       |       | 3     | 1     |        |
| 3.Yatırım araçlarını, yatırım ortamını ve piyasaları tanır. / Know investment tools, investment environment and markets.                                                                                                                                                                            | 5                                    | 4     | 4     | 4     | 1     | 2     | 2     | 1     | 1     | 1      |
| 4.Değişik finansal varlıkların değerlemesini yapabilir. / Can make the valuation of different financial assets.                                                                                                                                                                                     | 5                                    | 5     | 4     | 4     | 2     |       | 1     | 3     |       |        |
| 5.Portföy yönetimi teorilerini ve süreçlerini kavrar. / Understands portfolio management theories and processes.                                                                                                                                                                                    | 3                                    | 2     | 1     |       | 2     | 3     |       | 1     |       |        |
| 6.Portföy yönetiminde risk getiri analizi yapabilir. / Can make risk return analysis in portfolio management.                                                                                                                                                                                       | 4                                    | 3     | 1     |       | 4     | 1     |       | 3     |       |        |

Katkı Düzeyi / Contribution Level : 1-Çok Düşük / Very low, 2-Düşük / Low, 3-Orta / Moderate, 4-Yüksek / High, 5-Çok Yüksek / Very high