

## İçerik

| Ders Kodu | Dersin Adı                         | Yarıyıl | Teori | Uygulama | Lab | Kredisi | AKTS |
|-----------|------------------------------------|---------|-------|----------|-----|---------|------|
| LFM 513   | Yatırım Analizi ve Portföy Teorisi | 1       | 3     | 0        | 0   | 3       | 6    |

|                       |  |
|-----------------------|--|
| Ön Koşul              |  |
| Derse Kabul Koşulları |  |

|               |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                     |
|---------------|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| Dersin Dili   | İngilizce                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                           |
| Türü          | Seçmeli                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                             |
| Dersin Düzeyi | Yüksek Lisans                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                       |
| Dersin Amacı  | Lojistik ve Finansman Yönetimi yüksek lisans programının temellerinden olan finans ile doğrudan ilgili bu derste piyasa araçları tanınacaktır. Seçmeli bir ders olmasına karşın bu alanda çalışmak isteyen öğrencilerin bilmesi gereken temel konular işlenmektedir. Dersin amacı öncelikle piyasa araçlarının tanınması ve bunlardan nasıl yararlanılacağına yani yatırımların nasıl yapılacağına, analizinin, anlaşılmasıdır. Bütünlük olarak da piyasa araçlarından oluşturulacak portföyün kurulması ve optimizasyonu becerileri öğrencilere kazandırılacaktır. |
| İçerik        | Yatırım ve varlık dağıtımı;<br>Para piyasaları ve varlık piyasa endeksleri;<br>Etkin sermaye piyasaları;<br>Varlık fiyatlama yöntemlerine giriş,<br>Portföy yönetimine giriş,<br>Risk ve getirinin çok etkenli yöntemleri,<br>Hisse değerlemeye giriş,<br>Hisselerin yönetimi ve analizi;<br>Tahvil temelleri; tahvil değerlendirme analizi; tahvil portföy yönetim stratejileri<br>Portföy seçim matematiği;<br>Portföy seçiminde farklı yöntemler;<br>Portföy seçiminde farklı yöntemler;<br>Portföy performansı değerlendirmesi;<br>Proje sunumları              |
| Kaynaklar     | • Reilly, F. K., and Brown, K. C., "Investment Analysis and Portfolio Management", 10th ed., South-Western, Cengage Learning, Mason 2012.<br>• Bodie, Zvi, Kane, Alex, and Marcus, Alan J., "Investments", 4th ed., Mc-Graw-Hill, Singapore, 1999.                                                                                                                                                                                                                                                                                                                  |

## Teori Konu Başlıkları

| Hafta | Konu Başlıkları                                                                     |
|-------|-------------------------------------------------------------------------------------|
| 1     | Yatırım ve varlık dağıtımı;                                                         |
| 2     | Para piyasaları ve varlık piyasa endeksleri;                                        |
| 3     | Etkin sermaye piyasaları;                                                           |
| 4     | Varlık fiyatlama yöntemlerine giriş,                                                |
| 5     | Portföy yönetimine giriş,                                                           |
| 6     | Risk ve getirinin çok etkenli yöntemleri,                                           |
| 7     | Hisse değerlemeye giriş,                                                            |
| 8     | Hisselerin yönetimi ve analizi;                                                     |
| 9     | Tahvil temelleri; tahvil değerlendirme analizi; tahvil portföy yönetim stratejileri |
| 10    | Portföy seçim matematiği;                                                           |
| 11    | Portföy seçiminde farklı yöntemler;                                                 |
| 12    | Portföy seçiminde farklı yöntemler;                                                 |
| 13    | Portföy performansı değerlendirmesi;                                                |
| 14    | Proje sunumları                                                                     |