İçerik

Ders Kodu	Dersin Adı	Yarıyıl	Teori	Uygulama	Lab	Kredisi	AKTS
LFM 511	İleri Finansman Yönetimi	1	3	0	0	3	6

Ön Koşul	
Derse Kabul Koşulları	

Dersin Dili	İngilizce
Türü	Zorunlu
Dersin Düzeyi	Yüksek Lisans
Dersin Amacı	Lojistik ve Finansman Yönetimi alanlarında çalışacak uzman yetiştirmeyi amaçlayan yüksek lisans programında zorunlu ders olarak verilen İleri Finansman Yönetimi dersi sayesinde öğrencilerin edinecekleri bilgi birikimi, gerek bu sektörde çalışanların kariyer hedeflerine ulaşmalarına gerekse diğer sektörlerde çalışmayı düşünenlerin kendi uzmanlaşma alanlarında finansal boyutları düşünme ve çözüm bulma yeteneklerinin gelişmesine yardımcı olacaktır. Bu kapsamda dersin amacı, öğrencilerin, işletmelerin finansal performanslarını değerlendirebilmelerini, portföy optimizasyonu, tahvil ve hisse senedi değerlemesi ile yatırım kararlarının nasıl alındığı hakkında detaylı bilgi sahibi olmalarını sağlamaktır.
İçerik	Finansal Tablolar, Finansal Oran Analizi, Finansal Planlama, Finansal Tahmin Yöntemleri, Sermaye Bütçeleme Yöntemleri ve Yatırım Kararları, Yatırım Kararlarında Risk Faktörü, Markowitz Modeli, Sermaye Varlıklarını Fiyatlandırma Modeli (CAPM), Arbitraj Fiyatlama Teorisi (APT), Küresel Tahvil Piyasaları, Tahvil ve Hisse Senedi Değerlemesi, Sermaye Maliyeti, Riske Maruz Değer (VaR), Finansal Türev Ürünlerin Özellikleri, Opsiyon Değerlemesinin Temelleri.
Kaynaklar	Weston, J.F., Brigham, E.F., Essentials of Managerial Finance, Ninth Edition, The Dryden Press, 1990. Zutter, C.J., Smart, S.B., Principles of Managerial Finance, Fifteenth edition, Pearson, 2019.

Teori Konu Başlıkları

Hafta	Konu Başlıkları
1	Giriş ve organizasyon, Temel finansal tablolar (Bilanço, Gelir Tablosu).
2	Fon akım tablosu, Nakit akış tablosu, Enflasyon ve şirket performansına etkisi.
3	Finansal oran analizi: Likidite oranları, Varlık yönetimi oranları, Finansal yapı oranları, Kârlılık oranları, Piyasa değeri oranları, Du Pont sistemi, Oran analizinin kullanımları ve sınırlamaları.
4	Finansal tahmin, Satışların yüzdesi yöntemi. Finansal planlama: Başabaş analizi, Faaliyet kaldıraçı, Finansal kaldıraç, Toplam kaldıraç.
5	Paranın zaman değeri, Risk ve getiri, Riskin tanımlanması ve ölçülmesi, Risk ve getiri oranları arasındaki ilişki, Çeşitlendirme ve portföy riski.
6	Markowitz portföy seçim modeli.
7	Sermaye varlıklarını fiyatlandırma modeli (CAPM), Arbitraj fiyatlama teorisinin (APT) temelleri, Küresel tahvil piyasaları.
8	Ara sınav
9	Tahvil ve hisse senedi değerlemesi: Tahvil değerlemesi, Hisse senedi değerlemesi.
10	Portföy performansı değerlendirme yöntemleri, Sermaye bütçeleme yöntemleri.
11	Sermaye maliyeti, Riske maruz değer (Value at risk “VaR”).
12	Finansal türev ürünlere ilişkin temel bilgiler, Opsiyon piyasalarının temelleri, Opsiyon kontratı, Call (alma) opsiyonları, Put (satma) opsiyonları, Opsiyon stratejileri.
13	Opsiyon değerleme yöntemleri.
14	Proje Sunumları.