

Ders Kodu Dersin Adı Yarıyıl Teori Uygulama Lab Kredisi AKTS

IND423 Finans Mühendisliği 8 3 0 0 3 5

Ön Koşul

Derse Kabul Koşulları

Dersin Dili Fransızca

Türü Zorunlu

Dersin Düzeyi Lisans

İşletmelerde finansal analiz ve finansal yönetim kavramları öğrenciler için büyük önem taşımaktadır. Programda zorunlu olarak sunulan bu ders sayesinde öğrencilerin edinecekleri bilgi birikimi, gerek finans sektöründe gerekse üretim ve hizmet sektörlerindeki şirketlerin finans birimlerinde, temel finansal analiz yöntemlerini ve kurumsal finans araçlarını kullanmada ve uygulamada yardımcı olacaktır. Bu bağlamda dersin amaçları şu şekilde belirlenmiştir:

Dersin Amacı

- Öğrencilerin, işletmelerde finansal yönetimin temel kavramlarına hakim olmalarını sağlamak,
- Öğrencilerin, finansal analiz, finansal tahmin ve finansal bütçeleme yöntemlerini kavramalarını sağlamak,
- Öğrencilerin, yatırım kararlarını etkileyen faktörler hakkında bilgilendirilmelerini sağlamak,
- İşletmelerde temel finansal kararların ve uygulamaların finansal piyasalar çerçevesinde gerçekleşmesi sürecinin anlaşılabilirliğini sağlamak.

1. Hafta: İşletme çevrimleri. Finansal tablolar ile ilgili temel kavramlar.

2. Hafta: Nakit akışlarının analizi. Kaynak kullanım tablosu. Nakit akışı tablosu.

3. Hafta: Kaynak kullanım tablosu ve nakit akışı tablosu uygulamaları.

4. Hafta: Finansal oran analizi. Likidite oranları. Varlık yönetimi oranları. Borç yönetimi oranları. Karlılık oranları. Piyasa oranları.

5. Hafta: Faaliyet kaldıraç; Finansal kaldıraç; Toplam kaldıraç. Başabaş analizi.

6. Hafta: Finansal tahmin modelleri. Finansal matematik.

7. Hafta: Ara Sınav

İçerik

8. Hafta: Yatırımların yönetiminde risk faktörü. Portföyün riskinin belirlenmesi. Portföy oluşturmada çeşitlendirme. Risk ve getiri arasındaki ilişki. Risk değerinin hesaplanması.

9. Hafta: Modern portföy teorisi (MPT). Sermaye varlıklarını fiyatlandırma modeli (CAPM).

10. Hafta: Portföy performansının ölçülmesi. Riske maruz değer (Value at risk - VaR).

11. Hafta: Sermaye bütçeleme yöntemleri. Sermaye maliyeti. İskontolanmış nakit akışı yöntemiyle şirket değerinin hesaplanması.

12. Hafta: Hisse senedi ve tahvillerin değerlendirilmesi.

13. Hafta: Finansal opsiyon teorisine giriş. Temel kavramlar. Opsiyon çeşitleri.

14. Hafta: Proje sunumları

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 İşletme çevrimleri. Finansal tablolar ile ilgili temel kavramlar.

2 Nakit akışlarının analizi. Kaynak kullanım tablosu. Nakit akışı tablosu.

3 Kaynak kullanım tablosu ve nakit akışı tablosu uygulamaları.

4 Finansal oran analizi. Likidite oranları. Varlık yönetimi oranları. Borç yönetimi oranları. Karlılık oranları. Piyasa oranları.

5 Faaliyet kaldıraç; Finansal kaldıraç; Toplam kaldıraç. Başabaş analizi.

6 Finansal tahmin modelleri. Finansal matematik.

7 Ara Sınav

8 Yatırımların yönetiminde risk faktörü. Portföyün riskinin belirlenmesi. Portföy oluşturmada çeşitlendirme. Risk ve getiri arasındaki ilişki. Risk değerinin hesaplanması.

9 Modern portföy teorisi (MPT). Sermaye varlıklarını fiyatlandırma modeli (CAPM).

10 Portföy performansının ölçülmesi. Riske maruz değer (Value at Risk - VaR).

11 Sermaye bütçeleme yöntemleri. Sermaye maliyeti. İskontolanmış nakit akışı yöntemiyle şirket değerinin hesaplanması.

12 Hisse senedi ve tahvillerin değerlendirilmesi.

13 Finansal opsiyon teorisine giriş. Temel kavramlar. Opsiyon çeşitleri.

14 Proje sunumları