

## 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; Para piyasaları ve varlık piyasa endeksleri; Etkin sermaye piyasaları; Varlık fiyatlama yöntemlerine giriş, Portföy yönetimine giriş, Risk ve getirinin çok etkenli yöntemleri, Hisse değerlemeye giriş, Hisselerin yönetimi ve analizi; Tahvil temelleri; tahvil değerlendirme analizi; tahvil portföy yönetim stratejileri Portföy seçim matematiği; Portföy seçiminde farklı yöntemler; Portföy seçiminde farklı yöntemler; Portföy performansı değerlendirmesi; Proje sunumları
Kaynaklar	<ul style="list-style-type: none"><li>• Reilly, F. K., and Brown, K. C., "Investment Analysis and Portfolio Management", 10th ed., South-Western, Cengage Learning, Mason 2012.</li><li>• Bodie, Zvi, Kane, Alex, and Marcus, Alan J., "Investments", 4th ed., Mc-Graw-Hill, Singapore, 1999.</li></ul>

## 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