



| Ders Adı               | Kodu  | Yarıyıl | T+U Saat | AKTS | Z / S   |
|------------------------|---|---------|----------|------|---------|
| Finansal Risk Yönetimi | MUF424  | 8       | 3 + 0    | 3,0  | Seçmeli |
| Birim Bölüm            | Muhasebe ve Finans Yönetimi - Lisans (Yüz yüze)   |         |          |      |         |
| Amaç                   | Finansal riskler, risk ve beklenen getiri, riskin ve beklenen getirinin ölçülmesi, portföy risk ve getirisinin hesaplanması, finansal risk yönetimi, risk yönetim süreci, faiz riskinin yönetimi, kur riskinin yönetimi, piyasa riskinin yönetimi, geleneksel risk yönetim araçları ve türev ürünler hakkında öğrencileri bilgi sahibi kılarak, bu konularda öğrencilere yorum ve analiz yeteneğinin kazandırılması |         |          |      |         |
| Ders İçeriği           | Finansal risk, beklenen getiri, risk türleri, risk yönetimi ve süreçleri, portföy ve piyasa riski ve yönetimi, portföy riskinin hesaplanması, risk yönetimi süreçleri, kur riski ve yönetimi, geleneksel risk yönetimi ve türev ürünler.  |         |          |      |         |
| Ders Kaynakları        | Robert Kolb and James A. Overdahl, Financial Derivatives: Pricing and Risk Management, Wiley, 2009.,<br>Ali Ceylan ve Turhan Korkmaz, Finansal Teknikler, 7. Baskı, Ekin Kitabevi, Bursa, 2010. ,<br>Nurgül Chambers, Türev Piyasalar, Beta Basım Yayım, İstanbul, 2007.  |         |          |      |         |

| Hafta | Konu  |
|-------|---|
| 1     | Risk türleri ve riskin hesaplanması                               |
| 2     | Döviz kuru yaklaşımları, hesaplanması ve uluslar arası ilişkiler  |
| 3     | Faiz oranları, durasyon ve konveksite                             |
| 4     | Risk yönetimi ve sigortacılık                                     |
| 5     | Risk yönetimi ve türev ürünler                                    |
| 6     | Spot piyasalar ve OTC piyasa işlemleri                            |
| 7     | Forward, Future işlemler ve fiyatlaması                           |
| 8     | Forward, Future işlemler ve fiyatlaması                           |
| 9     | Opsiyonlar- Black-Scholes ve Binomial fiyatlama yaklaşımları      |
| 10    | Swap işlemleri  |
| 11    | Hedging   |
| 12    | Portföy riski yönetimi  |
| 13    | İşletme içi risk yönetim teknikleri                               |
| 14    | Uluslararası işlemlerde ortaya çıkan risklerden korunma ve rating |

| Ders İş Yüğü  | Çalışma Türü / Öğretim Metotlar | Süresi (Saat) | Sayısı |
|---|---------------------------------|---------------|--------|
| Dinleme ve anlamlandırma  | Ders                            | 3             | 14     |
| Araştırma – yaşam boyu öğrenme, yazma, okuma, Bilişim                                 | Sınıf Dışı Çalışma              | 3             | 6      |
| Dinleme ve anlamlandırma, gözlem/durumları işleme, eleştirel düşünme, soru geliştirme | Tartışmalı Ders                 | 3             | 6      |
| Ara Sınav 1   |                                 | 1             | 1      |
| Final   |                                 | 1             | 1      |
| Ders İş Yüğü:   |                                 | 80            |        |
| AKTS (Ders İş Yüğü / 25.5):   |                                 | 3,14          |        |

| Program Çıktıları |   |
|-------------------|---|
| 1                 | Muhasebe ve finans alanında güncel kuramsal ve uygulamalı bilgilere sahip olur.   |
| 2                 | Muhasebe bilgilerini stratejik, taktik ve operasyonel boyutlarda kullanabilir ve bu bilgileri örgütsel düzeyde analiz edebilir ve tasarlayabilir.   |
| 3                 | Kamu ve özel sektör iş yaşamının gerektirdiği, hem teorik hem de uygulama bazındaki muhasebe ve finans konularıyla iş yaşamına kolayca adaptasyon sağlar.   |
| 4                 | Bilişim teknolojileri başta olmak üzere, muhasebe ve finans alanındaki çağdaş yöntem ve teknolojilerdeki güncel gelişmeleri izler, bunları etkili bir şekilde kullanabilir ve kendini sürekli yenileme becerisi kazanır                         |
| 5                 | Kamu ve özel sektör kuruluşlarındaki alanı ile ilgili süreçleri yerinde inceleyerek uygulama becerisi kazanır   |
| 6                 | Çevreye, sosyal sorumluluğa, kaliteye, yenilikçiliğe her şart altında önem verir ve verileri ilgili doğrultuda toplayabilir.  |
| 7                 | Bireysel ve ekip üyesi olarak sorumluluk alır, açık fikirli, eleştiriye açık, yapıcı ve özgüven sahibi olur, etkin ve verimli çalışır.  |
| 8                 | İş etiğinin değerlerine uymanın gereğini özümser, muhasebe ve finans alanı ile ilgili verilerin toplanması, yorumlanması, duyurulması ve uygulanması aşamalarında her şart altında toplumsal, bilimsel ve etik değerlere sahip olur ve uygular. |
| 9                 | Liderlik vasıflarını kazanmak ve başarı ile uygulamak   |
| 10                | Bir yabancı dili kullanarak muhasebe ve finans alanı ile ilgili bilgileri izler ve meslektaşları ile iletişim kurar   |
| 11                | Yerel, ulusal, uluslararası ve küresel boyutlarda muhasebe ve finans alanındaki hem teorik hem de pratik değişim ve gelişimi izleme becerisi kazanır.   |
| 12                | Takım çalışmasına uyumlu, inisiyatif sahibi, analitik düşünebilen, yenilik ve değişime açık, girişimci, yaşam boyu öğrenme davranışı kazanır.   |
| 13                | Alanı ile ilgili ileri düzeydeki bir çalışmayı bağımsız olarak yürütebilir.   |
| 14                | Toplumsal Sosyal sorumluluk bilinci ile yaşadığı sosyal çevre için projeler ve etkinlikler düzenleyebilir.  |

**Ders Öğrenme Çıktısı - Program Çıktıları (1 -5 Puan Aralığı)**

| Ders Öğrenme Çıktısı   | PÇ 1 | PÇ 2 | PÇ 3 | PÇ 4 | PÇ 5 | PÇ 6 | PÇ 7 | PÇ 8 | PÇ 9 | PÇ 10 | PÇ 11 | PÇ 12 | PÇ 13 | PÇ 14 |
|--|------|------|------|------|------|------|------|------|------|-------|-------|-------|-------|-------|
| Finansal kararlar için değerlendirme raporu hazırlayabilecektir.   | 4    | 4    | 4    | 4    | 4    | 4    | 4    | 4    | 1    | 4     | 4     | 4     | 4     | 4     |
| Finansal risk yönetimi süreçleri açıklayabilecektir.               | 4    | 4    | 4    | 4    | 4    | 4    | 4    | 4    | 1    | 4     | 4     | 4     | 4     | 4     |
| Finansal Risk Yönetimi için gerekli süreçleri analiz edebilecektir | 3    | 4    | 5    | 3    | 4    | 4    | 4    | 4    | 1    | 4     | 5     | 4     | 4     | 4     |
| Finansal risk yönetiminde ortaya çıkan problemleri çözebilecektir. | 4    | 4    | 4    | 4    | 4    | 4    | 4    | 4    | 1    | 4     | 4     | 4     | 4     | 4     |

<https://ebs.bilecik.edu.tr/pdf/dersbilgigetir/332369>