



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 Veren	Dr. Öğr. Üyesi Vahdet ALTUNDAL				
Ders Kaynakları	Robert Kolb and James A. Overdahl, Financial Derivatives: Pricing and Risk Management, Wiley, 2009., Ali Ceylan ve Turhan Korkmaz, Finansal Teknikler, 7. Baskı, Ekin Kitabevi, Bursa, 2010. , 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, eleştireliye 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/332500>