



Ders Adı	Kodu	Yarıyıl	T+U Saat	AKTS	Z / S
Finansal Risk Yönetimi	BAF309	5	3 + 0	5,0	Zorunlu
Birim Bölüm	Finans ve Bankacılık - 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	Doç. Dr. Melik KAMIŞLI				
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 Kavramı ve Riskin Sınıflandırılması
2	Risk Yönetimi
3	Finansal Risk Türleri
4	Risk Hesaplamaları
5	Getiri Hesaplamaları
6	Risk Yönetim Teknikleri
7	Türev Ürünler ve Risk Yönetimi
8	Forward Sözleşmeler ve Türleri
9	Future Sözleşmeler ve Türleri
10	Swap Sözleşmeleri ve Türleri
11	Opsiyon Sözleşmeleri ve Türleri
12	Faiz Oranı Riski ve Yönetimi
13	Kur Riski ve Yönetimi
14	Portföy Riski Yönetimi

Ders İş Yükü	Çalışma Türü / Öğretim Metotlar	Süresi (Saat)	Sayısı
Dinleme ve anlamlandırma, gözlem/durumları işleme, eleştirel düşünme, soru geliştirme	Tartışmalı Ders	2	14
Dinleme ve anlamlandırma	Ders	5	14
Araştırma – yaşam boyu öğrenme, durumları işleme, soru geliştirme, yorumlama, sunum	Sözlü	1	14
Ara Sınav 1		1	1
Final		1	1
<b>Ders İş Yükü:</b>		114	
<b>AKTS (Ders İş Yükü / 25.5):</b>		4,47	

Program Çıktıları	
1	Paranın zaman değeri, risk-getiri dengesi gibi finans alanıyla ilgili temel kavramlar, teoriler ve uygulamalar hakkında güncel ve teorik bilgilere sahip olur.
2	Bankacılık sektörüyle ilgili temel bilgi, ilke ve uygulamaları bilir ve edindiği bilgi ve becerileri finansal süreçleri çözmeye kullanır, analitik ve stratejik düşünerek bankacılıkla ilgili verileri analiz edebilir.
3	Alanla ilgili edindiği bilgiler çerçevesinde, banka, yatırım şirketi, borsa vb. finansal kurumları, finansal piyasaları öğrenir ve bu piyasalarda işlem gören hisse senetleri, tahviller vb. finansal ürünleri analiz ederek, değerlendirebilir.
4	Alanla ilgili konularda ekip çalışmasının getireceği sorumluluklara açık olur.
5	Alanla ilgili konularda bireysel anlamda sorumluluğa açık olur.
6	Ulusal veya uluslararası finansal sistemlerin işleyişini anlayabilir, iflas, kriz vb. finansal olaylar arasında neden-sonuç ilişkisi kurar ve yorumlama becerisine sahip olur.
7	Finans ve bankacılık sektörüyle ilgili bilgi ve becerileri yazılı ve sözlü olarak aktarır ve iletişim kurar.
8	Finansal konularda gelişmeleri takip edebilecek ve iletişim kurabilecek düzeyde bir yabancı dili anlayabilir ve kullanabilir.
9	Yatırım analizi ve portföy yönetimi başta olmak üzere finans ve bankacılık sektörünün gerektirdiği düzeyde bilgi, iletişim teknolojileri ve paket programları kullanabilir.
10	Alanla ilgili konularda toplumsal refahı ön planda tutar ve etik değerlere uygun değerlendirerek yorum yapar.
11	Bankacılık sektörünün iç ve dış çevresinde tüm paydaşlarını gözeterek şekilde ilişkileri izleyebilir, sorunları tanımlar ve çözüm önerileri geliştirme yetkinliğine sahip olur.
12	Çevreye, sosyal sorumluluğa, kaliteye ve yenilikçiliğe her şart altında önem verir ve finansal verileri bu doğrultuda toplayıp değerlendirir.
13	Finans ve bankacılık konularında edindiği bilgi ve becerileri sürekli geliştirerek ömür boyu öğrenmeye açık ve bankacılık sektörüyle ilgili güncel gereksinimleri karşılama becerisine sahiptir.
14	Finans ve bankacılık sektörüyle ilgili bilgileri eleştirel bir bakış açısıyla değerlendirir.
15	Finans ve bankacılık sektörü ile edindiği bilgi birikimi ile, küresel ekonomide ve uluslararası bankacılıkta yaşanan süreçleri izleyebilir.

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

Ders Öğrenme Çıktısı	PÇ1	PÇ2	PÇ3	PÇ4	PÇ5	PÇ6	PÇ7	PÇ8	PÇ9	PÇ10	PÇ11	PÇ12	PÇ13	PÇ14	PÇ15
Türev ürünlerin risk yönetiminde kullanımını açıklayabilir.	4	4	5	3	3	5	2	2	4	2	4	3	5	4	5
Riskleri tanımlayabilir ve sınıflandırabilir.	5	4	5	3	3	5	2	3	2	2	4	2	3	3	2
Türev ürün çeşitlerini ve türev piyasaların işleyişini açıklayabilir.	4	4	5	3	3	5	2	2	4	2	4	3	5	4	5
Risk yönetim tekniklerini kıyaslayabilir.	5	4	5	3	3	5	2	3	2	2	4	2	3	3	2
Ortalama Değer	4,5	4	5	3	3	5	2	2,5	3	2	4	2,5	4	3,5	3,5

<https://ebs.bilecik.edu.tr/pdf/dersbilgigetir/341155>