



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 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 Metotları	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 Yüğü:</b>		114	
<b>AKTS (Ders İş Yüğü / 25.5):</b>		4,47	

Program Çıktıları	
1	Finans alanıyla ilgili temel kavramlara, güncel ve teorik bilgilere sahip olur.
2	Alanla ilgili edindiği bilgi ve becerileri finansal süreçleri çözmeye kullanır, analitik ve stratejik düşünerek uygulamaya geçirebilir.
3	Alanla ilgili edindiği bilgiler çerçevesinde finansal piyasaları ve finansal kurumları değerlendirebilir.
4	Alanla ilgili konularda ekip çalışmasının getireceği sorumluluklara açık olur.
5	Alanla ilgili konularda bireysel anlamda sorumluluğa açık olur.
6	Finansal olaylar arasında neden-sonuç ilişkisi kurar ve yorumlar.
7	Finansal konularla 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	Alanın 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	Finansal piyasa ve kurumların iç ve dış çevresinde tüm paydaşlarını gözeterek şekilde ilişkilerini izleyebilir.
12	Çevreye, sosyal sorumluluğa, kaliteye ve yenilikçiliğe her şart altında önem verir, verileri ilgili doğrultuda toplar.
13	Finans ve bankacılık konularında edindiği bilgi ve becerileri sürekli geliştirerek ömür boyu öğrenmeye açıktır.
14	Alanla ilgili konularda bilgi ve becerileri eleştirel bir bakış açısıyla değerlendirebilir.
15	Genelde finans, özelden ise bankacılık konuları ile ilgili bilgi birikimine sahip olur ve ekonomide yaşanan süreçleri izleyebilir.

**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	PÇ 15
Finansal kararlar için değerlendirme raporu hazırlayabilecektir.	1	1	1	1	1	1	3	3	3	3	5	5	5	5	-
Finansal risk yönetimi süreçleri açıklayabilecektir.	3	3	3	3	3	3	5	5	5	5	5	5	5	5	-
Finansal Risk Yönetimi için gerekli süreçleri analiz edebilecektir	2	2	2	3	5	5	5	5	5	5	5	5	5	5	-
Finansal risk yönetiminde ortaya çıkan problemleri çözebilecektir.	1	1	1	3	3	3	5	5	5	5	5	5	5	5	-

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