



Ders Adı	Kodu	Yarıyıl	T+U Saat	AKTS	Z / S
Ekonomik Risk Yönetimi	IKT463	7	3 + 0	5,0	Seçmeli
Birim Bölüm	İktisat - Lisans (yüz yüze ve online eğitim)				
Amaç	Öğrencinin finansal risk yönetimi süreçleri açıklayabilmesi, risk türleri ve risk hesaplamalarını yapabilmesi, döviz kuru yaklaşımlarını, hesaplanmasını ve uluslararası ilişkilerini tanımlayabilmesi, faiz oranları, durasyon ve konveksiteyi tanımlayabilmesi, risk yönetimi ve türev ürünleri tanımlayabilmesini sağlamak.				
Ders İçeriği	Faiz oranları, durasyon ve konveksite. Risk yönetimi ve sigortacılık. Risk yönetimi ve türev ürünler. Spot piyasalar ve OTC piyasa işlemleri. Forward işlemler ve fiyatlaması. Future işlemler ve piyasalar. Opsiyonlar- Black-Scholes ve Binomial fiyatlama yaklaşımları Swap işlemleri, Hedging Portföy riski yönetimi, İşletme içi risk yönetim teknikleri (offsetting, leading, lagging...) Uluslararası işlemlerde ortaya çıkan risklerden korunma ve rating				
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 Yayın, İstanbul, 2007.				

Hafta	Konu
1	Risk türleri ve riskin hesaplanması
2	Döviz kuru yaklaşımları, hesaplanması ve uluslararası 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

Program Çıktıları

- İktisat teorisi, kavramları ve yöntemleri hakkında kapsamlı bilgiye sahip olur.
- Farklı disiplinlerden edindiği bilgi ve yöntemleri birleştirerek karşılaştığı konu ve sorunların çözümünde bütüncül bir anlayışa sahip olur.
- İktisadi bakış açısını geliştirmek için farklı disiplinlerden faydalanır.
- Ulusal ve uluslararası gelişmelere iktisat perspektifinden yaklaşarak, eleştirel düşünme ve analiz yapabilme becerisi kazanır.
- Toplumsal ve çevresel sorunlara duyarlılık geliştirerek, eleştirel düşünme ve yenilikçi çözüm yaklaşımlarıyla bilimsel öneriler sunma becerisi kazanır.
- Yaşam boyu öğrenme bilinci ile iktisat alanındaki yenilikleri takip eder ve bu yenilikleri kendi çalışmalarına entegre eder.
- Alanındaki gelişmeleri takip edebilecek düzeyde Türkçe ve yabancı dil bilgisine sahip olarak yazılı-sözlü iletişim kurma becerisi kazanır.
- Bağımsız çalışabilme ve ekip içinde etkin bir şekilde iş birliği yapabilme becerisi geliştirir.
- Çeşitli bilgi ve verileri toplama, analiz etme ve bu verileri yorumlayarak iktisadi olguları anlama ve karar alma süreçlerinde kullanabilme becerisi kazanır.
- İktisat teorisinin ve ekonomik kurumların tarihsel gelişimini anlar ve bu bağlamda ekonomik politikaları değerlendirme becerisi kazanır.
- İktisadi politikaları sonuçlarıyla beraber analiz eder ve sorunların çözümüne yönelik sürdürülebilir öneriler geliştirir.
- İktisadın özelleşmiş alt alanlarında da bilgi sahibi olur ve bu alanlara yönelik analitik düşünme becerileri geliştirir.
- İktisadi analizlerde matematik ve istatistik bilimleri ile ekonometrik yöntemleri etkin bir şekilde kullanır.

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
Finansal kararlar için değerlendirme raporu hazırlayabilecektir.	4	-	2	3	3	4	1	1	4	4	4	3	4
Finansal risk yönetimi süreçleri açıklayabilecektir.	4	-	2	3	3	4	1	1	4	4	4	3	4
Finansal Risk Yönetimi için gerekli süreçleri analiz edebilecektir	4	-	2	3	3	4	1	1	4	4	4	3	4
Finansal risk yönetiminde ortaya çıkan problemleri çözebilecektir.	4	-	2	3	3	4	1	1	4	4	4	3	4
İktisadi politikaları sonuçlarıyla birlikte analiz ve sonuca yönelik sürdürülebilir çözümler geliştirir.	4	-	2	3	3	4	1	1	4	4	5	3	2
Ortalama Değer	4	-	2	3	3	4	1	1	4	4	4,2	3	3,6