



Ders Adı	Kodu	Yarıyıl	T+U Saat	AKTS	Z / S
Finansal Risk Yönetimi	BFİ5507		3 + 0	7,5	Seçmeli
Birim Bölüm	Bankacılık ve Finans - YL İÖ - Lisansüstü (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., 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

- Farklı lisans programlarından mezun olanların finans alanıyla ilgili temel kavramlara, güncel ve teorik bilgilere sahip olmak
- Alanla ilgili edindiği bilgi ve becerileri finansal süreçleri çözmede kullanmak, analitik ve stratejik düşünerek uygulamaya geçirebilmek
- Alanla ilgili edindiği bilgiler çerçevesinde finansal piyasaları ve finansal kurumları değerlendirebilmek
- Alanla ilgili konularda ekip çalışmasının getireceği sorumluluklara açık olmak
- Alanla ilgili konularda bireysel anlamda sorumluluğa açık olmak
- Finansal olaylar arasında neden-sonuç ilişkisi kurabilmek ve yorumlayabilmek
- Finansal konularla ilgili bilgi ve becerileri yazılı ve sözlü olarak aktarabilmek, iletişim kurabilmek
- Finansal konularda gelişmeleri takip edebilecek ve iletişim kurabilecek düzeyde bir yabancı dili anlamak ve kullanmak
- Alanın gerektirdiği düzeyde bilgi, iletişim teknolojileri ve paket programları kullanabilmek
- Alanla ilgili konularda toplumsal refahı ön planda tutabilmek ve etik değerlere uygun değerlendirebilmek ve yorum yapabilmek
- Finansal piyasa ve kurumların iç ve dış çevresinde tüm paydaşlarını gözeterek şekilde ilişkilerini izleyebilmek
- Çevreye, sosyal sorumluluğa, kaliteye ve yenilikçiliğe her şart altında önem vermek, verileri ilgili doğrultuda toplayabilmek
- Bankacılık ve finans konularında edindiği bilgi ve becerileri sürekli geliştirerek ömür boyu öğrenmeye açık olmak
- Alanla ilgili konularda bilgi ve becerileri eleştirel bir bakış açısıyla değerlendirebilmek
- Genelde finans, özelde ise bankacılık konuları ile ilgili bilgi birikimine sahip olarak, ekonomide yaşanan süreçleri izleyebilmek

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.	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Finansal risk yönetimi süreçleri açıklayabilecektir.	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Finansal Risk Yönetimi için gerekli süreçleri analiz edebilecektir	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Finansal risk yönetiminde ortaya çıkan problemleri çözebilecektir.	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Ortalama Değer	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-