



Ders Adı	Kodu	Yarıyıl	T+U Saat	AKTS	Z / S
Finansal Risk Yönetimi	BF15507		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 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

#### Program Çıktıları

1	Farklı lisans programlarından mezun olanların finans alanıyla ilgili temel kavramlara, güncel ve teorik bilgilere sahip olmak
2	Alanla ilgili edindiği bilgi ve becerileri finansal süreçleri çözmeye kullanmak, analitik ve stratejik düşünerek uygulamaya geçirebilmek
3	Alanla ilgili edindiği bilgiler çerçevesinde finansal piyasaları ve finansal kurumları değerlendirebilmek
4	Alanla ilgili konularda ekip çalışmasının getireceği sorumluluklara açık olmak
5	Alanla ilgili konularda bireysel anlamda sorumluluğa açık olmak
6	Finansal olaylar arasında neden-sonuç ilişkisi kurabilmek ve yorumlayabilmek
7	Finansal konularla ilgili bilgi ve becerileri yazılı ve sözlü olarak aktarabilmek, iletişim kurabilmek
8	Finansal konularda gelişmeleri takip edebilecek ve iletişim kurabilecek düzeyde bir yabancı dili anlamak ve kullanmak
9	Alanın gerektirdiği düzeyde bilgi, iletişim teknolojileri ve paket programları kullanabilmek
10	Alanla ilgili konularda toplumsal refahı ön planda tutabilmek ve etik değerlere uygun değerlendirebilmek ve yorum yapabilmek
11	Finansal piyasa ve kurumların iç ve dış çevresinde tüm paydaşlarını gözeterek şekilde ilişkilerini izleyebilmek
12	Çevreye, sosyal sorumluluğa, kaliteye ve yenilikçiliğe her şart altında önem vermek, verileri ilgili doğrultuda toplayabilmek
13	Bankacılık ve finans konularında edindiği bilgi ve becerileri sürekli geliştirerek ömür boyu öğrenmeye açık olmak
14	Alanla ilgili konularda bilgi ve becerileri eleştirel bir bakış açısıyla değerlendirebilmek
15	Genelde finans, özelden 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	PÇ1	PÇ2	PÇ3	PÇ4	PÇ5	PÇ6	PÇ7	PÇ8	PÇ9	PÇ10	PÇ11	PÇ12	PÇ13	PÇ14	PÇ15
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.	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-