



## Ders Bilgi Formu

| Ders Adı                       | Kodu    | Yerel Kredi | AKTS | Ders (saat/hafta) | Uygulama (saat/hafta) | Laboratuvar (saat/hafta) |
|--------------------------------|---------|-------------|------|-------------------|-----------------------|--------------------------|
| Risk Yönetimi ve Türev Ürünler | ISL6144 | 3           | 7.5  | 3                 | 0                     | 0                        |

|            |     |
|------------|-----|
| Önkoşullar | Yok |
|------------|-----|

|         |       |
|---------|-------|
| Yarıyıl | Bahar |
|---------|-------|

|             |        |
|-------------|--------|
| Dersin Dili | Türkçe |
|-------------|--------|

|                 |                  |
|-----------------|------------------|
| Dersin Seviyesi | Doktora Seviyesi |
|-----------------|------------------|

|                 |                       |
|-----------------|-----------------------|
| Ders Kategorisi | Temel Meslek Dersleri |
|-----------------|-----------------------|

|                      |          |
|----------------------|----------|
| Dersin Veriliş Şekli | Yüz yüze |
|----------------------|----------|

|                            |                |
|----------------------------|----------------|
| Dersi Sunan Akademik Birim | İşletme Bölümü |
|----------------------------|----------------|

|                     |           |
|---------------------|-----------|
| Dersin Koordinatörü | Atanmamış |
|---------------------|-----------|

|                  |            |
|------------------|------------|
| Dersi Veren(ler) | Güler Aras |
|------------------|------------|

|               |                     |
|---------------|---------------------|
| Asistan(lar)ı | Özlem Kutlu Furtuna |
|---------------|---------------------|

|              |  |
|--------------|--|
| Dersin Amacı | Bu dersin amacı; faiz, kur ve fiyat değişimlerinden kaynaklanan finansal risklerin yönetilmesi için gereken finansal risk yönetim tekniklerinin ve araçlarının teorik ve uygulamalı olarak öğretilmesidir. |
|--------------|--|

|                |   |
|----------------|---|
| Dersin İçeriği | Finansal Risk Teorisi, Riskin Ölçümü ve Değerlemesi, Finansal Futures İle Hedging ve Spekülasyon, Döviz, Faiz ve Endeks Futures, Forward Kontratlar, Opsiyon Piyasalar, Opsiyon Değerleme Modelleri, Swap Türleri ve Swapların Fiyatlandırılması, İleri Türev Piyasa Stratejileri |
|----------------|---|

|                               |     |
|-------------------------------|-----|
| Opsiyonel Program Bileşenleri | Yok |
|-------------------------------|-----|

### Ders Öğrenim Çıktıları

|   |   |
|---|---|
| 1 | Öğrenciler - Türev araçlar hakkında genel bilgiler öğreneceklerdir. - . |
|---|---|

|   |   |
|---|---|
| 2 | Opsiyon fiyatlama stratejileri konusunda bilgi sahibi olacaklardır. |
|---|---|

|   |  |
|---|--|
| 3 | Türkiye'de ve dünyada Türev piyasaların işleyişi ile ilgili yöntemler hakkında bilgi sahibi olacaklardır |
|---|--|

|   |  |
|---|--|
| 4 | Uluslararası türev piyasalar hakkında bilgi sahibi olacaklardır. |
|---|--|

### Haftalık Konular ve İlgili Ön Hazırlık Çalışmaları

| Hafta | Konular  | Ön Hazırlık               |
|-------|--|---------------------------|
| 1     | Finansal Risk Teorisi                          | Hull4thEd;ss.1-15         |
| 2     | Riskin Ölçümü ve Değerlemesi                   | Hull4thEd;ss.285-298      |
| 3     | Finansal Risk Yönetimi ve Türev Piyasalar      | Hull4thEd;ss.16-40        |
| 4     | Finansal Futures ile Hedging ve Spekülasyon    | Hull4thEd;ss.73-98        |
| 5     | Döviz, Faiz ve Endeks Futures                  | İlgili kitap ve makaleler |
| 6     | Forward Kontratlar                             | Hull4thEd;ss.40-71        |
| 7     | Opsiyon Piyasalar                              | İlgili kitap ve makaleler |
| 8     | Midterm 1 / Practice or Review                 |                           |
| 9     | Opsiyon Alım Satım Stratejileri, Fiyatlandırma | Hull4thEd;ss.202-217      |

|    |   |                           |
|----|---|---------------------------|
| 10 | Opsiyon Değerleme Modelleri                 | Hull4thEd;ss.255-270      |
| 11 | Swap Piyasalar Hakkında Genel Bilgiler      | Hull4thEd;ss.133-158      |
| 12 | Swap Türleri ve Swapların Fiyatlandırılması | Hull4thEd;ss.160-181      |
| 13 | İleri Türev Piyasa Stratejileri             | Hull4thEd;ss.412-421      |
| 14 | Türkiye'de ve Dünyada Türev Piyasalar       | Hull4thEd;ss.422-431      |
| 15 | Final                                       | İlgili kitap ve makaleler |
| 16 | Final Sınavı                                |                           |

## Değerlendirme Sistemi

| Etkinlikler   | Sayı | Katkı Payı |
|---|------|------------|
| Devam/Katılım                                       |      |            |
| Laboratuvar   |      |            |
| Uygulama  |      |            |
| Arazi Çalışması                                     |      |            |
| Derse Özgü Staj                                     |      |            |
| Küçük Sınavlar/Stüdyo Kritiği                       |      |            |
| Ödev  | 1    | 15         |
| Sunum/Jüri  | 3    | 15         |
| Projeler  |      |            |
| Seminer/Workshop                                    |      |            |
| Ara Sınavlar  | 1    | 30         |
| Final   | 1    | 40         |
| <b>Dönem İçi Çalışmaların Başarı Notuna Katkısı</b> |      | 60         |
| <b>Final Sınavının Başarı Notuna Katkısı</b>        |      | 40         |
| <b>TOPLAM</b>                                       |      | 100        |

## AKTS İşyükü Tablosu

| Etkinlikler   | Sayı | Süresi (Saat) | Toplam İşyükü |
|---|------|---------------|---------------|
| Ders Saati  | 14   | 3             | 42            |
| Laboratuvar   |      |               |               |
| Uygulama  |      |               |               |
| Arazi Çalışması                                     |      |               |               |
| Sınıf Dışı Ders Çalışması                           | 14   | 6             | 84            |
| Derse Özgü Staj                                     |      |               |               |
| Ödev  | 2    | 25            | 50            |
| Küçük Sınavlar/Stüdyo Kritiği                       |      |               |               |
| Projeler  | 1    | 20            | 20            |
| Sunum / Seminer                                     |      |               |               |
| Ara Sınavlar (Sınav Süresi + Sınav Hazırlık Süresi) | 1    | 14            | 14            |
| Final (Sınav Süresi + Sınav Hazırlık Süresi)        | 1    | 15            | 15            |

|                              |      |
|------------------------------|------|
| <b>Toplam İşyükü</b>         | 225  |
| <b>Toplam İşyükü / 30(s)</b> | 7.50 |
| <b>AKTS Kredisi</b>          | 7.5  |

|              |     |
|--------------|-----|
| Diğer Notlar | Yok |
|--------------|-----|