



Ders Bilgi Formu

Ders Adı	Kodu	Yerel Kredi	AKTS	Ders (saat/hafta)	Uygulama (saat/hafta)	Laboratuvar (saat/hafta)
Finansal Risk Yönetimi	ISL4942	3	5	3	0	0

Önkoşullar	Yok
------------	-----

Yarıyıl	Güz, Bahar
---------	------------

Dersin Dili	İngilizce, Türkçe
-------------	-------------------

Dersin Seviyesi	Lisans Seviyesi
-----------------	-----------------

Ders Kategorisi	Uzmanlık/Alan Dersleri
-----------------	------------------------

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

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

Dersin Koordinatörü	Güler Aras
---------------------	------------

Dersi Veren(ler)	
------------------	--

Asistan(lar)ı	
---------------	--

Dersin Amacı	Bu dersin amacı; finansal risk yönetim tekniklerinin, araçlarının temel olarak öğretilmesi ve türev piyasalar hakkında bilgi verilmesidir.
--------------	--

Dersin İçeriği	Finansal Risk Kavramı, Portföy Riskinin Ölçülmesi, Futures Piyasaların İşleyişi, Futures Kontratların Fiyatlandırılması, Finansal Futures İle Hedging ve Spekülasyon, Forward Kontratların Türleri, Opsiyon Piyasalar Hakkında Genel Bilgiler, Swap Türleri ve Swapların Fiyatlandırılması, Türev Piyasa Stratejileri, Türkiye’de Türev Piyasalar
----------------	---

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

Ders Öğrenim Çıktıları

1	Öğrenciler, finansal risk yönetimi tekniklerini öğreneceklerdir;
2	future ve forward piyasaların farklarını ve işleyişini öğreneceklerdir;
3	opsiyon piyasalar hakkında genel bilgiler öğreneceklerdir;
4	türev piyasa stratejilerini ve Türkiye’de türev piyasaların işleyişi ile ilgili yöntemler hakkında bilgi sahibi olacaklardır.
5	finansal risk yönetimine ilişkin güncel yaklaşımlar hakkında bilgi sahibi olacaklardır.

Haftalık Konular ve İlgili Ön Hazırlık Çalışmaları

Hafta	Konular	Ön Hazırlık
1	Finansal Risk Yönetiminde Temel Kavramlar	Shapiro2009 (Bl.1)
2	Risk, Getiri ve Beta	Shapiro2009 (Bl.2)
3	Portföy Riskinin ve Getirisinin Hesaplanması	Shapiro2009 (Bl.3)
4	Riske Maruz Değer Kavramı	Shapiro2009 (Bl.3)
5	Futures Piyasalar Hakkında Genel Bilgiler	Shapiro2009 (Bl.4)
6	Finansal Futures İle Hedging ve Spekülasyon	Shapiro2009 (Bl.5)

7	Forward Kontratlar Hakkında Genel Bilgiler, Forward Kontratların Türleri	Shapiro2009 (Bl.6)
8	Midterm 1 / Practice or Review	
9	Futures ve Forward Kontratların Karşılaştırılması	Shapiro2009 (Bl.6)
10	Opsiyon Piyasalar Hakkında Genel Bilgiler	Shapiro2009 (Bl.8)
11	Swap Piyasalar Hakkında Genel Bilgiler	Shapiro2009 (Bl.8)
12	Swap Türleri ve Swapların Fiyatlandırılması	Shapiro2009 (Bl.9)
13	Finansal Riskin Ölçülmesine İlişkin Modeller	Shapiro2009 (Bl.10)
14	Ülke Riski ve Uluslararası Finansal Risk Yönetimi	Shapiro2009 (Bl.12)
15	Final	
16		

Değerlendirme Sistemi

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

AKTS İşyükü Tablosu

Etkinlikler	Sayı	Süresi (Saat)	Toplam İşyükü
Ders Saati	13	3	39
Laboratuvar			
Uygulama			
Arazi Çalışması			
Sınıf Dışı Ders Çalışması	13	4	52
Derse Özgü Staj			
Ödev	1	20	20
Küçük Sınavlar/Stüdyo Kritiği			

Projeler			
Sunum / Seminer			
Ara Sınavlar (Sınav Süresi + Sınav Hazırlık Süresi)	1	10	10
Final (Sınav Süresi + Sınav Hazırlık Süresi)	1	20	20
Toplam İşyükü			141
Toplam İşyükü / 30(s)			4.70
AKTS Kredisi			5

Diğer Notlar	Yok
--------------	-----