



Ders Bilgi Formu

Ders Adı	Kodu	Yerel Kredi	AKTS	Ders (saat/hafta)	Uygulama (saat/hafta)	Laboratuvar (saat/hafta)
Finansal Risk Analizi	IKT5304	3	7.5	3	0	0

Önkoşullar	Yok
------------	-----

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

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

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

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

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

Dersi Sunan Akademik Birim	İktisat Bölümü
----------------------------	----------------

Dersin Koordinatörü	Asuman Oktayer
---------------------	----------------

Dersi Veren(ler)	Asuman Oktayer, Ensar Yılmaz
------------------	------------------------------

Asistan(lar)ı	
---------------	--

Dersin Amacı	Bu dersin temel amacı öğrenciye finansal risk analizinin temel kuramsal kavram ve yaklaşımlarının neler olduğunu ve bunların pratikte nasıl kullanıldığını öğretmektir. Dersin içeriği, hızla gelişen ve değişen günümüz finans dünyasında öğrencilerimizin aktif görevler almasına yardımcı olacaktır.
--------------	---

Dersin İçeriği	Temel olasılık kavramları; Risk ve belirsizlik; Risk ve getiri ilişkisi; Risk, riski yayma (diversification) ve hedging; Risk türleri: piyasa riski, kredi riski, likidite riski, faiz riski, kur riski, hukuki riskler; Finansal riskin ölçülmesi: Boşluk (gap), süre (duration) ve senaryo analizleri; Risk değerlendirme: riskin belirlenmesi (identification), riskin kontrolü, riskin finansmanı teknikleri, risk yönetiminde karar verme teknikleri; Türevler ve türev modellerle risk yönetimi; Davranışsal finans ve risk; Organizasyonun toplu riski: Value at Risk (VaR) analizi; Getiri (yield) eğrileri; Sigortacılık temel ilkeleri.
----------------	---

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

Ders Öğrenim Çıktıları

1	Bu dersi başarıyla tamamlayan öğrenci, finansal risk teknikleri hakkında temel becerileri kazanabilecektir,
2	Finans piyasalarındaki riskler hakkında ayrıntılı bilgiye sahip olabilecektir,
3	Ekonomideki, finansal risklerin etkileri üzerinde tartışma yeteneği kazanacaktır.

Haftalık Konular ve İlgili Ön Hazırlık Çalışmaları

Hafta	Konular	Ön Hazırlık
1	Temel olasılık kavramları; Risk ve belirsizlik; Risk ve getiri ilişkisi	1 No'lu kaynak kitabın ilgili ünitesi
2	Riski yayma (diversification) ve hedging	1 No'lu kaynak kitabın ilgili ünitesi
3	Risk türleri: piyasa riski, kredi riski, likidite riski, faiz riski, kur riski, hukuki riskler	1 No'lu kaynak kitabın ilgili ünitesi
4	(Devam)	1 No'lu kaynak kitabın ilgili ünitesi
5	Finansal riskin ölçülmesi: Boşluk (gap), süre (duration) ve senaryo analizleri;	2 No'lu kaynak kitabın ilgili ünitesi

6	(Devam)	2 No'lu kaynak kitabın ilgili ünitesi
7	1. Vize Sınavı	
8	Risk değerlendirme: riskin belirlenmesi (identification), riskin kontrolü, riskin finansmanı teknikleri, risk yönetiminde karar verme teknikleri	2 No'lu kaynak kitabın ilgili ünitesi
9	(Devam)	2 No'lu kaynak kitabın ilgili ünitesi
10	Türevler ve türev modellerle risk yönetimi	2 ve 3 No'lu kaynak kitapların ilgili üniteleri
11	Organizasyonun toplu riski: Value at Risk (VaR) Analizi	2 ve 3 No'lu kaynak kitapların ilgili üniteleri
12	Getiri (yield) Eğrileri	3 No'lu kaynak kitabın ilgili ünitesi
13	2. Vize Sınavı	
14	Sigortacılık temel ilkeleri, fiyatlandırma, risk hesabı	3 No'lu kaynak kitabın ilgili ünitesi
15	Davranışsal finans ve risk	3 No'lu kaynak kitabın ilgili ünitesi

Değerlendirme Sistemi

Etkinlikler	Sayı	Katkı Payı
Devam/Katılım		
Laboratuvar		
Uygulama		
Arazi Çalışması		
Derse Özgü Staj		
Küçük Sınavlar/Stüdyo Kritiği		
Ödev		
Sunum/Jüri		
Projeler	1	20
Seminer/Workshop		
Ara Sınavlar	2	40
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	16	3	48
Laboratuvar			
Uygulama			
Arazi Çalışması			
Sınıf Dışı Ders Çalışması	16	5	80
Derse Özgü Staj			

Ödev			
Küçük Sınavlar/Stüdyo Kritiği			
Projeler	1	20	20
Sunum / Seminer			
Ara Sınavlar (Sınav Süresi + Sınav Hazırlık Süresi)	2	25	50
Final (Sınav Süresi + Sınav Hazırlık Süresi)	1	20	20
Toplam İşyükü			218
Toplam İşyükü / 30(s)			7.27
AKTS Kredisi			7.5

Diğer Notlar	Yok
--------------	-----