

İSTATİSTİKSEL RİSK ANALİZİ

1	Ders Adı:	İSTATİSTİKSEL RİSK ANALİZİ
2	Ders Kodu:	EKO5109
3	Ders Türü:	Seçmeli
4	Ders Seviyesi	Yüksek Lisans
5	Dersin Verildiği Yıl:	1
6	Dersin Verildiği Yarıyıl	1
7	Dersin AKTS Kredisi:	3.00
8	Teorik Ders Saati (saat/Hafta)	2.00
9	Uygulama Ders Saati(saat/Hafta)	0.00
10	Laboratuvar Ders Saati (saat/hafta) :	0
11	Dersin Önkoşulu:	Yok
12	Dersin Dili:	Türkçe
13	Dersin Veriliş Şekli:	Yüz yüze
14	Dersin Koordinatörü:	Doç. Dr. ÖZER ARABACI
15	Dersi Veren Diğer Öğretim Elemanları:	
16	Koordinatör İletişim Bilgileri:	Uludağ Üniv. İİBF Ekonometri Bölümü Görükle Kampüsü Bursa Tel: 0.224.2941110 ozerarabaci@uludag.edu.tr
17	Dersin WEB adresi:	
18	Dersin Amacı:	Riski tanımlayarak, öğrencilerin riskin analiz edilmesi ve yönetilmesi ile ilgili teknikler konusunda bilgi sahibi kılmak.
19	Dersin Mesleki Gelişime Katkısı:	
20	Dersin Öğrenme Kazanımları:	
	1	Risk ve risk analizi kavramlarına ilişkin temel bilgiler, risk ve belirsizlik arasındaki ilişki öğrenilmiş olacak.
	2	Risk analizine ilişkin temel istatistiksel yöntemler öğrenilerek uygulanabiliyor olacak.
	3	Olasılık teorisi ve olasılığın risk analizindeki önemi kavranmış olacak, kesikli ve sürekli olasılık dağılımları öğrenilecek.
	4	Finans sektöründe karşılaşılan risk türleri öğrenilecek.
	5	Risk yönetimi kavramı ve geleneksel risk yönetimi yöntemleri öğrenilecek.
	6	Önemli bir risk yönetim aracı olan Riske Maruz Değer yöntemi, yonteme ilişkin temel parametreler öğrenilecek.
	7	Riske maruz değer hesaplanmasında kullanılan Varyans-Kovaryans yöntemi, Delta Gamma yöntemi ve delta normal yöntemi öğrenilecek ve hesaplanabiliyor olacak.
	8	Riske maruz değer hesaplanmasında kullanılan Parametrik olmayan yöntemler ile RMD hesaplamaları yapabiliyor olacak.
	9	
	10	
21	Dersin İçeriği:	
Hafta	DERS İÇERİKLERİ	

	Teorik	Uygulama
1	Risk Analizi İle İlgili Kavramlar	
2	Olasılık Teorisi	
3	Monte Carlo Simülasyonu	
4	Stokastik Süreçler	
5	Olasılık Dağılımları	
6	Model Parametreleri İle İlgili Belirsizliğin Hesaplanması	
7	Risk Analizi Modelinin Oluşturulması	
8	Verilere Uygun Teorik Dağılımın Belirlenmesi	
9	Uzman Görüşlerinden Hareketle Model Oluşturma	
10	Monte Carlo Simülasyonu Uygulamaları	
11	Model Sonuçlarının Değerlendirilmesi	
12	Risk Yönetimi	
13	Sigorta Risklerinin Modellenmesi	
14	Finansal Risklerin Modellenmesi	
22	Ders Kitabı, Referanslar ve/veya Diğer Kaynaklar:	1- Risk Analysis: A Quantitative Guide , David Vose WİLEY; 3 EDITION (MAY 19, 2008) 2- Probabilistic Risk Analysis: Foundations And Methods Tim Bedford And Roger Cooke ;Cambridge University Press; 1 Edition 2001) 3- Risk Analysis: Assessing Uncertainties Beyond Expected Values And Probabilities Terje Aven Wileyblackwell; 2008
23	Değerlendirme	
YARIYIL İÇİ ÇALIŞMALARİ		SAYISI
Ara Sınav		0
Kısa Sınav		0
Ödev		0
Yıl Sonu Sınavı		1
Toplam		1
Yıl içi çalışmalarının Başarıya Oranı		0.00
Finalin Başarıya Oranı		100.00
Toplam		100.00
Kullanılan Ölçme ve Değerlendirme Yaklaşımları		
24	AKTS / İŞ YÜKÜ TABLOSU	

ETKİNLİK	SAYISI	Süresi (Saat)	Toplam İş Yüğü (Saat)
Teorik Dersler	14	2.00	28.00
Uygulamalı Dersler	0	0.00	0.00
Sınıf Dışı Ders Çalışma Süresi (Ön çalışma, pekiştirme)	0	0.00	0.00
Ödevler	2	15.00	30.00
Projeler	0	0.00	0.00
Arazi Çalışmaları	0	0.00	0.00
Arasınaylar	0	0.00	0.00
Diğer	0	0.00	0.00
Yarıyıl Sonu Sınavı	1	25.00	25.00
Toplam İş Yüğü			83.00
Toplam İş Yüğü / 30 saat			2.77
Dersin AKTS Kredisi			3.00

25	PROGRAM YETERLİLİKLERİ İLE DERS ÖĞRETİM KAZANIMLARI İLİŞKİSİ TABLOSU															
	PY1	PY2	PY3	PY4	PY5	PY6	PY7	PY8	PY9	PY10	PY11	PY12	PY13	PY14	PY15	PY16
ÖK1	1	4	2	1	1	3	1	1	1	1	1	1	0	0	0	0
ÖK2	4	4	4	2	3	3	3	3	4	4	4	4	0	0	0	0
ÖK3	4	4	4	2	3	3	3	3	4	4	4	4	0	0	0	0
ÖK4	1	4	2	1	1	3	1	1	1	1	1	1	0	0	0	0
ÖK5	1	4	2	1	1	3	1	1	1	1	1	1	0	0	0	0
ÖK6	4	4	4	4	3	3	3	3	4	4	4	4	0	0	0	0
ÖK7	4	4	4	3	4	4	3	3	4	4	4	4	0	0	0	0
ÖK8	4	4	4	2	3	4	3	3	4	4	4	4	0	0	0	0
ÖK: Öğrenme kazanımlar PY: Program yeterlilikleri																
Katkı Düzeyi:	1 çok düşük			2 Düşük			3 Orta			4 Yüksek			5 Çok Yüksek			