

FİNANSAL RİSK ANALİZİ ve YÖNETİMİ

1	Ders Adı:	FİNANSAL RİSK ANALİZİ ve YÖNETİMİ
2	Ders Kodu:	ISL6107
3	Ders Türü:	Seçmeli
4	Ders Seviyesi	Doktora
5	Dersin Verildiği Yıl:	1
6	Dersin Verildiği Yarıyıl	1
7	Dersin AKTS Kredisi:	4.00
8	Teorik Ders Saati (saat/Hafta)	3.00
9	Uygulama Ders Saati(saat/Hafta)	0.00
10	Laboratuvar Ders Saati (saat/hafta) :	0
11	Dersin Önkoşulu:	
12	Dersin Dili:	Türkçe
13	Dersin Veriliş Şekli:	Yüz yüze
14	Dersin Koordinatörü:	Prof. Dr. Adem Anbar
15	Dersi Veren Diğer Öğretim Elemanları:	Doç.Dr. Adem ANBAR
16	Koordinatör İletişim Bilgileri:	Doç.Dr. Adem ANBAR aadem@uludag.edu.tr
17	Dersin WEB adresi:	
18	Dersin Amacı:	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.
19	Dersin Mesleki Gelişime Katkısı:	Finansal riskler ve finansal risk yönetimi konuları ve uygulamaları hakkında bilgi sahibi olmak.
20	Dersin Öğrenme Kazanımları:	
	1	Riski tanımlayabilme ve risk yönetimini açıklayabilme.
	2	Portföy riskini ve portföyün getirisini hesaplayabilme.
	3	Güncel risk yönetimi uygulamalarını şekillendiren teorileri karşılaştırabilme.
	4	Vadeli işlem sözleşmeleri, opsiyon sözleşmeleri ve swap işlemlerinin işleyişini ve nasıl kullanıldığını kavrayabilme.
	5	Finansal risk yönetiminde kullanılan türev ürünleri karşılaştırabilme.
	6	Makroekonomik ve politik riskleri ve bunların ne şekilde yönetildiğini açıklayabilme.
	7	İçsel ve dışsal risk gibi alanda meydana gelen yeni gelişmeleri takip edebilme.
	8	
	9	
	10	
21	Dersin İçeriği:	
Hafta	DERS İÇERİKLERİ	
	Teorik	Uygulama

1	Finansal Riskler ve Risk Kaynakları	
2	Finansal Risk ve Beklenen Getirinin Ölçülmesi	
3	Portföy Riskinin ve Getirisinin Hesaplanması	
4	Finansal Risk Yönetimi: Tanımı, Amacı, Aşamaları	
5	Geleneksel Riskten Korunma Yöntemleri: Çeşitlendirme, Sigorta, Factoring, Forfaiting ve İhracat Kredi Sigortası	
6	Türev Ürünlerin Risk Yönetim Aracı Olarak Kullanılması	
7	Risk Yönetim Aracı Olarak Futures ve Forwards Sözleşmeleri	
8	Risk Yönetim Aracı Olarak Swap ve Opsiyon Sözleşmeleri	
9	Türev Ürünlerin Riskinin Yönetimi	
10	Faiz Riskinin Yönetimi	
11	Kur Riskinin Yönetimi	
12	Kredi Riskinin Yönetimi	
13	Diğer Finansal Risklerin Yönetimi : Fiyat, Likidite ve Operasyonel Risklerin Yönetimi	
14	Ülke Riski ve Uluslararası Risk Yönetimi	
22	Ders Kitabı, Referanslar ve/veya Diğer Kaynaklar:	1. Burak SALTOĞLU, Finansal Risk Yönetimi, 2020. 2. Mehmet Baha KARAN, Yatırım Analizi ve Portföy Yönetimi, 2020. 3. Adem ANBAR - Lale KARABIYIK, Sermaye Piyasası ve Yatırım Analizi, 2018. 4. John C. Hull, Options, Futures, and Other Derivatives, 2014.
23	Değerlendirme	
YARIYIL İÇİ ÇALIŞMALARI		SAYISI
Ara Sınav		0
Kısa Sınav		0
Ödev		2
Yıl Sonu Sınavı		1
Toplam		3
Yıl içi çalışmalarının Başarıya Oranı		50.00
Finalin Başarıya Oranı		50.00
Toplam		100.00
Kullanılan Ölçme ve Değerlendirme Yaklaşımları		Klasik yazılı sınav + ödev
24	AKTS / İŞ YÜKÜ TABLOSU	

ETKİNLİK	SAYISI	Süresi (Saat)	Toplam İş Yüğü (Saat)
Teorik Dersler	14	3.00	42.00
Uygulamalı Dersler	0	0.00	0.00
Sınıf Dışı Ders Çalışma Süresi (Ön çalışma, pekiştirme)	14	3.00	42.00
Ödevler	2	10.00	20.00
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	20.00	20.00
Toplam İş Yüğü			124.00
Toplam İş Yüğü / 30 saat			4.13
Dersin AKTS Kredisi			4.00

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	0	0	4	3	0	0	0	0	0	0	4	0	0	0	0	0
ÖK2	0	0	4	3	0	0	0	0	5	0	4	0	0	0	0	0
ÖK3	0	0	4	3	0	0	0	0	0	0	4	0	0	0	0	0
ÖK4	0	0	4	3	0	0	0	0	5	0	4	0	0	0	0	0
ÖK5	0	0	4	3	0	0	0	0	5	0	4	0	0	0	0	0
ÖK6	0	3	4	3	0	0	0	0	0	0	4	0	0	0	0	0
ÖK7	0	3	4	3	0	0	0	0	0	0	4	0	0	0	0	0
ÖK: Öğrenme kazanımlar PY: Program yeterlilikleri																
Katkı Düzeyi:	1 çok düşük		2 Düşük		3 Orta		4 Yüksek		5 Çok Yüksek							