

DERS BİLGİLERİ FORMU

Dersi Açan Fakülte/ Enstitü	İİBF
Dersi Açan Bölüm/ Ana Bilim Dalı	İşletme
Dersin Kodu	İŞL 461
Dersin Adı	Risk Yönetimi
Öğretim Dili	İngilizce
Dersi Alan Programlar	İşletme
Ders Türü	Finans alanı zorunlu
Dersin Seviyesi	Lisans
AKTS Kredisi	6
Ön Koşullar	İŞL 368
Dersin İçeriği	Bu ders finans piyasalarında karşılaşılan risk türlerinin inceleyerek başlar. Riskin ölçümü, uygun araç ve tekniklerle riskten korunma, risk yönetim politikaları, risk yönetiminde finansal türev araçların kullanımı dersin kapsamı içindedir.
Dersin Amacı	Bu dersin iki ana amacı bulunmaktadır: 1. Öğrencilerin bir yatırım riskini nasıl tanımlayabileceklerini, ölçebileceklerini ve analiz edebileceklerini öğrenmeleri, 2. Özellikle finansal türev araçlarının kullanımı yoluyla riskin nasıl kontrol edilebileceğini ve yönetilebileceğini öğrenmeleri
Dersin Kazanımları	Bu dersin sonunda öğrenciler; 1) Finans piyasalarında karşılaşılan risk türlerinin neler olduğunu ve nasıl ölçüldüğünü bilirler. 2) Finansal kurumlar ve şirketler perspektifinden finansal risk yönetiminin prensiplerini ve aşamalarını bilirler 3) Uygun riskten korunma ve riski yönetme yaklaşımlarını bilirler 4) Risk yönetiminde türev araçların kullanımını bilirler 5) Finansal kurumlar için BASEL uygulamalarını ve BDDK'nın düzenlemelerini bilirler, değişiklikleri takip edebilirler.
Ders Kitabı ve/veya Kaynaklar	1) Financial Institutions Management. A Risk Management Approach by Saunders and Cornett, Irwin/McGraw-Hill; 4th edition, 2002 2) Options, Futures and Other Derivatives by John C. Hull, Prentice Hall; 6th edition, 2006 3) Risk Management and Financial Institutions by John C. Hull, Prentice Hall; 2007
Değerlendirme Ölçütleri	
Devam	
Laboratuvar	
Uygulama	
Alan Çalışması	
Ödev	10%
Sunum	
Projeler	
Seminer	
Ara Sınavlar	30%
Quiz	20%
Final	40%
Toplam	100

Ders Planı	Tartışılacak/ İşlenecek Konular
1. Hafta	Dersin genel tanıtımı
2. Hafta	Risk ve Risk Yönetimi
3. Hafta	Faiz Oranı Riski
4. Hafta	Faiz Oranı Riski, Piyasa Riski

5. Hafta	Piyasa Riski
6. Hafta	Kredi Riski
7. Hafta	Kredi Riski, Arasınav
8. Hafta	Bilanço Dışı Aktiviteler
9. Hafta	Teknoloji ve Diğer Operasyonel Riskler
10. Hafta	Kur Riski
11. Hafta	BASEL ve BDDK uygulamaları
12. Hafta	Örnek olay çalışması