

İçerik

Ders Kodu	Dersin Adı	Yarıyıl	Teori	Uygulama	Lab	Kredisi	AKTS
LFM 512	Finansal Risk Analizi ve Türevler	2	3	0	0	3	6

Ön Koşul	
Derse Kabul Koşulları	

Dersin Dili	İngilizce
Türü	Seçmeli
Dersin Düzeyi	Yüksek Lisans
Dersin Amacı	Mükemmel koruma riskleri tamamen ortadan kaldırandır. Pratikte mükemmel korunmalar nadirdir. Risk analizinde taraflar yüz yüze kaldıkları riskten vadeli piyasaları kullanarak kaçınmak isterler. Dolayısıyla, bu ders finansal türevler, ispatları ve risk analizi konularına hâkimiyeti sağlayacaktır. Ayrıca verilecek proje ile öğrenciler kendi ilgi alanı olan konularla (lojistik, finans ve iş) türevleri bütünlüştirebilecektir.
İçerik	Giriş: Vadeli Piyasaların Mekaniği Vadeli fiyatların belirlenmesi Vadeliiler kullanılarak korunma stratejileri Faiz oranı piyasaları Swaplar Hisse opsiyonlarının özellikleri Opsiyonlar kullanılarak alış-satış stratejileri Binomial Ağaçlar Black-Scholes Modeli Duyarlılık analizi Gerçek opsiyonlar, sigorta, hava koşulları ve enerji türevleri
Kaynaklar	John C. Hull, Options, Futures, and Other Derivatives, 8th Edition, Prentice Hall, 2012.

Teori Konu Başlıkları

Hafta	Konu Başlıkları
1	Giriş: Vadeli Piyasaların Mekaniği
2	Vadeli fiyatların belirlenmesi
3	Vadeli fiyatların belirlenmesi 2
4	Vadeliler kullanılarak korunma stratejileri
5	Faiz oranı piyasaları
6	Swaplar
7	Hisse opsiyonlarının özellikleri
8	Opsiyonlar kullanılarak alış-satış stratejileri
9	Binomial Ağaçlar
10	Black-Scholes Modeli
11	Duyarlılık analizi
12	Gerçek opsiyonlar, sigorta, hava koşulları ve enerji türevleri
13	Duyarlılık Analizi
14	Gerçek opsiyonlar, sigorta, hava opsiyonları