

İçerik

Ders Kodu	Dersin Adı	Yarıyıl	Teori	Uygulama	Lab	Kredisi	AKTS
G570	Risk Yönetimi	2	3	0	0	3	6

Ön Koşul	
Derse Kabul Koşulları	

Dersin Dili	Türkçe
Türü	Seçmeli
Dersin Düzeyi	Yüksek Lisans
Dersin Amacı	Dersin amacı, öğrencilere finansal risk kavramını tanıtmak, riskli projelerin değerlendirilmesi ve risk yönetimi hakkında temel bilgileri vermektir.
İçerik	1. hafta: Risk kavramı 2. hafta: Riskin ölçülmesi 3. hafta : Belirsizlik ortamında karar verme 4. hafta: Riskli projelerin değerlendirilmesi 5. hafta: Riskin yönetimi 6. hafta: Forward işlemler 7. hafta: Futures kontratları 8. hafta: Vadeli faiz oranı anlaşmaları 9. hafta: Vize 10. hafta: Swap işlemleri 11. hafta: Alım ve satım opsiyonları 12. hafta: Opsiyon bileşimleri 13. hafta: Melez ve sentetik varlıklar 14. hafta: Riske maruz değer yaklaşımı
Kaynaklar	BOLAK, Mehmet ; “Finans Mühendisliği: Kavramlar ve Araçlar”, Beta Basım, Yayım, Dağıtım A.Ş., Ekim 1998, İstanbul. ERSAN, İhsan ; “ Finansal Türevler” Literatür Yayıncılık, Dağıtım, Pazarlama San. Ve Tic. Ltd., İstanbul, 1997 GALİTZ, Lawrence C. ; “Financial Engineering: Tools and Techniques to Manage Financial Risk”, Pitman Publishing Company, London, 1995 MARSHALL, John f., Vipul K. BANSAL; “Financial Engineering: A Complete Guide to Financial Innovation”, New York Institute of Finance,

Teori Konu Başlıkları

Hafta	Konu Başlıkları
1	Risk kavramı
2	Riskin ölçülmesi
3	Belirsizlik ortamında karar verme
4	Riskli projelerin değerlendirilmesi
5	Riskin yönetimi
6	Forward işlemler
7	Futures kontratları

Hafta	Konu Başlıkları
8	Vadeli faiz oranı anlaşmaları
9	Vize
10	Swap işlemleri
11	Alım ve satım opsiyonları
12	Opsiyon bileşimleri
13	Melez ve sentetik varlıklar
14	Riske maruz değer yaklaşımı