



AYDIN ADNAN MENDERES ÜNİVERSİTESİ
AYDIN İKTİSAT FAKÜLTESİ
EKONOMETRİ BÖLÜMÜ
EKONOMETRİ PROGRAMI
DERS BİLGİ FORMU

| | | | | | | | | | |
|-----------------------------------|---|---------|------------|-------------|---|----------|--------|-------------|---|
| Dersin Adı | Finansal Risk Yönetimi ve Türev Piyasalar | | | | | | | | |
| Ders Kodu | EF309 | | | Ders Düzeyi | | | Lisans | | |
| AKTS Kredi | 5 | İş Yüğü | 122 (Saat) | Teori | 3 | Uygulama | 0 | Laboratuvar | 0 |
| Dersin Amacı | Finansal piyasalar ve enstrümanları, forward, futures, options piyasaları ve özellikleri, 1987 ve 2008 küresel krizlerinde vadeli piyasaların rolü, yöntemleri ve İMKB –VOB piyasası hakkında bilgi vermek. | | | | | | | | |
| Özet İçeriği | Finansal piyasalar, vadeli(türev piyasalar); futures, options, swap piyasası özellikleri, krizlerde vadeli piyasaların rolü, portföy çeşitlendirmesi, Hedge fonlar ve finansal piyasalardaki rolleri. | | | | | | | | |
| Staj Durum | Yok | | | | | | | | |
| Öğretim Yöntemleri | Anlatım (Takrir), Tartışma | | | | | | | | |
| Dersi Veren Öğretim Elemanı(ları) | | | | | | | | | |

Ölçme ve Değerlendirme Araçları

| Araç | Adet | Oran (%) |
|---------------------------|------|----------|
| Ara Sınav (Vize) | 1 | 40 |
| Dönem Sonu Sınavı (Final) | 1 | 60 |

Ders Kitabı / Önerilen Kaynaklar

| | |
|---|--|
| 1 | Larry Neal 'The Economics of Europe and the European Union', Cambridge University press Mike Artis, Frederick Nixon 'The economics of the European Union, Policy and analysis Oxford pres, 2007. |
|---|--|

| Hafta | Haftalara Göre Ders Konuları | |
|-------|------------------------------|--|
| 1 | Teorik | Tanışma – Dersin Gerekçesi ve Önemi – Dersin Kural ve Gereklere Temel Kavramlara Genel Bir Bakış |
| 2 | Teorik | Türev Piyasalar ve araçları I |
| 3 | Teorik | Türev Piyasalar ve araçları II |
| 4 | Teorik | Forward işlemleri ve vadeli işlemler |
| 5 | Teorik | Forward işlemleri ve vadeli işlemler |
| 6 | Teorik | Hedging kavramları ve uygulamalar |
| 7 | Teorik | Hedging kavramları ve uygulamalar |
| 8 | Ara Sınav (Vize) | Ara Sınav |
| 9 | Teorik | Swap işlemleri |
| 10 | Teorik | Swap işlemleri |
| 11 | Teorik | Opsiyon işlemlerinin özellikleri I |
| 12 | Teorik | Opsiyon işlemlerinin özellikleri II |
| 13 | Teorik | Opsiyon fiyatlama modelleri I |
| 14 | Teorik | Opsiyon fiyatlama modelleri II |
| 15 | Teorik | Opsiyon ticaret stratejileri |
| 16 | Dönem Sonu Sınavı (Final) | Final Sınavı |

Dersin Öğrenme, Öğretme ve Değerlendirme Etkinlikleri Çerçevesinde İş Yüğü Hesabı (Ortalama Saat)

| Etkinlik | Adet | Ön Hazırlık | Etkinlik Süresi | Toplam İş Yüğü |
|---|------|-------------|-----------------|----------------|
| Kuramsal Ders | 14 | 3 | 3 | 84 |
| Bireysel Çalışma | 10 | 1 | 1 | 20 |
| Ara Sınav | 1 | 8 | 1 | 9 |
| Dönem Sonu Sınavı | 1 | 8 | 1 | 9 |
| Toplam İş Yüğü (Saat) | | | | 122 |
| Yuvarla [Toplam İş Yüğü (saat) / 25*] = AKTS Kredisi | | | | 5 |

*25 saatlik iş yüğü 1 AKTS olarak kabul edilmektedir.



Dersin Öğrenme Çıktıları

| | |
|---|--|
| 1 | Temel finansal türev piyasası kavramlarını anlayabilme |
| 2 | Finansal türev araçlarının fiyatlamasını yorumlayabilme |
| 3 | En önemli finansal türev piyasası araçlarını yorumlayabilme |
| 4 | Finansal türev piyasalarına ilişkin politika önerileri sunabilme |
| 5 | Finansal türev piyasalar kapsamında uygulama yapabilme |
| 6 | Finans piyasalarını tüm özellikleri ile sentez edebilme, gerçek yaşama uyarlayabilme |

Program Çıktıları (Ekonometri Programı)

| | |
|---|---|
| 1 | Ekonometrik kavramların öğrenilmesi |
| 2 | Ekonometrik model tahmin edebilme |
| 3 | Tahmin edilen ekonometrik modelin güvenilirliğini test edebilmek |
| 4 | Zaman serisi analizini öğrenme |
| 5 | Finansal varlıkların tanınması ve ekonomik birimlerin kararlarını ölçen analizlerin yapılması |
| 6 | Finansal verilerin analizleri için özellikle geliştirilmiş ekonometrik yöntemleri kullanabilme |
| 7 | Finans ve ekonomi alanlarının gerektirdiği düzeyde bilgisayar programları ile birlikte bilişim ve iletişim teknolojilerini ileri düzeyde kullanmak. |
| 8 | Para teorisi, uluslararası ticaret ve finans teorileri üzerine yapılabilecek ekonometrik uygulamalara temel olacak bilgilerin öğretilmesi |
| 9 | Bilimsel bir alanda detaylı literatür araştırması yapabilme, topladığı bilgileri sentezleyebilme, analiz edebilme, yorumlayabilme ve bulguları rapor haline getirebilme |

Program ve Öğrenme Çıktıları İlişkisi 1:Çok Düşük, 2:Düşük, 3:Orta, 4:Yüksek, 5:Çok Yüksek

| | ÖÇ1 | ÖÇ2 | ÖÇ3 | ÖÇ4 | ÖÇ5 | ÖÇ6 |
|-----|-----|-----|-----|-----|-----|-----|
| PÇ1 | 5 | 3 | 5 | 3 | 4 | 5 |
| PÇ2 | 4 | 3 | 4 | 3 | 5 | 2 |
| PÇ3 | 4 | 5 | 4 | 3 | 5 | 2 |
| PÇ4 | 4 | 5 | 4 | 5 | 5 | 5 |
| PÇ5 | 4 | 4 | 5 | 4 | 3 | 5 |
| PÇ6 | 2 | 4 | 5 | 4 | 3 | 5 |
| PÇ7 | 5 | 4 | 2 | 4 | 3 | 5 |
| PÇ8 | 5 | 4 | 2 | 4 | 3 | 5 |
| PÇ9 | 5 | 4 | 2 | 4 | 3 | 5 |

