



AYDIN ADNAN MENDERES ÜNİVERSİTESİ
SOSYAL BİLİMLER ENSTİTÜSÜ
İŞLETME ANABİLİM DALI
İŞLETME MUHASEBE VE FİNANSMAN PROGRAMI
İŞLETME MUHASEBE VE FİNANSMAN YÜKSEK LİSANS PROGRAMI
DERS BİLGİ FORMU

Dersin Adı	Finansal Risk Yönetimi								
Ders Kodu	İMF507			Ders Düzeyi			Yüksek Lisans		
AKTS Kredi	5	İş Yüğü	122 (Saat)	Teori	3	Uygulama	0	Laboratuvar	0
Dersin Amacı	Finansal sistemler ve ürünlerle ilgili risk analizi yaklaşımlarının öğretilmesi.								
Özet İçeriğı	Risk yönetiminin önemi, riskin ölçülmesi, piyasa riskinin ölçülmesi ve yönetimi riske maruz değer, Basel II, yaşanan finansal iflaslardan alınan dersler.								
Staj Durum	Yok								
Öğretim Yöntemleri	Anlatım (Takrir)								
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	Dun&Bradstreet, Financial Risk Management, Tata McGraw-Hill Publishing Company Limited, 2007.
---	---

Hafta	Haftalara Göre Ders Konuları	
1	Teorik	Riski Anlama
	Ön Hazırlık	Dun&Bradstreet, Financial Risk Management, Tata McGraw-Hill Publishing Company Limited, 2007.
2	Teorik	Risk Yönetiminin Faydaları
	Ön Hazırlık	Dun&Bradstreet, Financial Risk Management, Tata McGraw-Hill Publishing Company Limited, 2007.
3	Teorik	Riskin Sınıflandırılması
	Ön Hazırlık	Dun&Bradstreet, Financial Risk Management, Tata McGraw-Hill Publishing Company Limited, 2007.
4	Teorik	Riskin Ölçümü
	Ön Hazırlık	Dun&Bradstreet, Financial Risk Management, Tata McGraw-Hill Publishing Company Limited, 2007.
5	Teorik	Risk Yönetimi: Pazar Riskinin Yönetimi
	Ön Hazırlık	Dun&Bradstreet, Financial Risk Management, Tata McGraw-Hill Publishing Company Limited, 2007.
6	Teorik	Risk Yönetimi: Kredi Riskinin Yönetimi
	Ön Hazırlık	Dun&Bradstreet, Financial Risk Management, Tata McGraw-Hill Publishing Company Limited, 2007.
7	Teorik	Risk Yönetimi: Operasyonel Riskin Yönetimi
	Ön Hazırlık	Dun&Bradstreet, Financial Risk Management, Tata McGraw-Hill Publishing Company Limited, 2007.
9	Teorik	Risk Yönetimi Araçları: Türevler
	Ön Hazırlık	Dun&Bradstreet, Financial Risk Management, Tata McGraw-Hill Publishing Company Limited, 2007.
10	Teorik	Risk Yönetimi Araçları: SWAP
	Ön Hazırlık	Dun&Bradstreet, Financial Risk Management, Tata McGraw-Hill Publishing Company Limited, 2007.
11	Teorik	Risk Yönetiminde Karşılaşılan Diğer Sorunlar
	Ön Hazırlık	Dun&Bradstreet, Financial Risk Management, Tata McGraw-Hill Publishing Company Limited, 2007.
12	Teorik	Basel II
	Ön Hazırlık	Dun&Bradstreet, Financial Risk Management, Tata McGraw-Hill Publishing Company Limited, 2007.



13	Teorik	Örnek Olay Çalışması
	Ön Hazırlık	Dun&Bradstreet, Financial Risk Management, Tata McGraw-Hill Publishing Company Limited, 2007.
14	Teorik	Örnek Olay Çalışması
	Ön Hazırlık	Dun&Bradstreet, Financial Risk Management, Tata McGraw-Hill Publishing Company Limited, 2007.
15	Ön Hazırlık	Dun&Bradstreet, Financial Risk Management, Tata McGraw-Hill Publishing Company Limited, 2007.
16	Dönem Sonu Sınavı (Final)	Final Sınavı Final Exam
17	Dönem Sonu Sınavı (Final)	Final Sınavı Final Exam

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

Etkinlik	Adet	Ön Hazırlık	Etkinlik Süresi	Toplam İş Yükü
Kuramsal Ders	14	2	3	70
Ara Sınav	1	25	1	26
Dönem Sonu Sınavı	1	25	1	26
Toplam İş Yükü (Saat)				122
Yuvarla [Toplam İş Yükü (saat) / 25*] = AKTS Kredisi				5

*25 saatlik iş yükü 1 AKTS olarak kabul edilmektedir.

Dersin Öğrenme Çıktıları

1	Finansal sistemler ve ürünler kavramı
2	Finansal risk tanımlaması ve çözümlenmesine ilişkin yöntem ve teknikler bilgisi
3	Risk ölçümü, modellemesi, riske maruz değer hesaplamaları becerisi
4	Türev araçları tanıtılabilme
5	Riske göre düzeltilmiş sermaye getirisini hesaplayabilme

Program Çıktıları (İşletme Muhasebe ve Finansman Yüksek Lisans Programı)

1	Temel muhasebe bilgisi ve denetim ile ilgili hukuk dallarını bağdaştırabilme
2	Maliyet sistemleri kurulması ve geliştirilmesi ile ilgili teknik ve teorik bilgiler ile uygulamaya dönük çalışma yapma
3	İş hayatında aldığı kararlarda sosyal sorumluluk bilincini ve etik değerleri göz önünde bulundurabilme
4	Değişen iş koşullarında insiyatif alma, analitik ve yaratıcı yaklaşımlarla sorun çözebilme ve riski yönetebilme
5	Menkul kıymetler ve diğer organize piyasalardaki açıklanması zor hareketlerin insan psikolojisine dayandırılması ve aradaki ilişkinin incelenmesi
6	Edindiği teorik bilgileri uygulama ile bütünleştirerek içinde çalıştığı sistemin geliştirilmesine katkıda bulunma (Mesleğin sorunlarını anlayıp yorumlayarak, fikirlerini sözlü ve/veya yazılı, açık ve öz bir şekilde ifade edebilme becerisi
7	Türev ürünleri, döviz piyasaları ve uluslararası finansal pazarlarda gelişen olayları analiz edebilme ve yorumlama, bu piyasalarda türev ürünlerle işlem yapabilme
8	Temel finans ilkelerini karar alma sürecine uygulamak için matematiksel ve istatistik bilgisinden yararlanma, ekonometrik modellerin muhasebe finansman alanında uygulanması ve finans piyasalarındaki güncel veriler üzerinde test edebilme
9	Uluslararası finansal yönetim araçlarını, uluslararası finansal piyasaları ve aracı kurum ve kuruluşları tanıma ve bir şirketin finans yönetiminde gerektiği yerlerde bütün bunlardan yararlanma
10	Finansal piyasaları etkileyen küresel ve/veya yerel kriz durumlarını neden-sonuç ilişkisi içerisinde değerlendirme ve bu tür kriz ortamlarında bilgiye dayalı karar alma

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

	ÖÇ1	ÖÇ2	ÖÇ3	ÖÇ4	ÖÇ5
PÇ1	5	4	5	3	2
PÇ2	4	5	3	3	3
PÇ3	4	3	4	3	4
PÇ4	3	4	4	4	5
PÇ5	4	4	3	4	3
PÇ6	3	5	4	4	5
PÇ7	4	3	3	5	3



PÇ8	4	3	3	2	2
PÇ9	5	3	2	3	4
PÇ10	3	4	5	3	2

