



AYDIN ADNAN MENDERES ÜNİVERSİTESİ DERS BİLGİ FORMU

Dersin Adı		Finansal Risk Yönetimi							
Ders Kodu		UTIF313		Ders Düzeyi		Lisans			
AKTS Kredi	4	İş Yüğü	103 (Saat)	Teori	3	Uygulama	0	Laboratuvar	0
Dersin Amacı		Bu dersin ana amacı finansal risk yönetiminin ve risk yönetiminde kullanılan finansal araçların katılımcılara aktarılmasıdır. Ağırlık fiyat sabitleme (hedging) ve türev araçlar üzerinde olacaktır. Kurumsal risk yönetimiyle ilgili detaylı tartışmalara da yer verilecektir.							
Özet İçeriğı		Bu ders, risk yönetiminin evrimi, kurumsal risk yönetimi yaklaşımı, risk yönetiminin temel kavramları, risk yönetimi hedef ve stratejileri, risk yönetimi sistemlerinin tasarımı ve uygulanması konularını kapsamaktadır							
Staj Durum		Yok							
Öğretim Yöntemleri		Anlatım (Takrir)							
Dersi Veren Öğretim Elemanı(ları)			Doç. Dr. Umut Tolga GÜMÜŞ						

Ders Koşulları

AKTS Kredi Koşulu	40
-------------------	----

Ölçme ve Değerlendirme Araçları

Araç	Adet	Oran (%)
Ara Sınav (Vize)	1	40
Dönem Sonu Sınavı (Final)	1	70

Ders Kitabı / Önerilen Kaynaklar

1	Enterprise-wide Risk Management, Strategies for linking risk and opportunity, James Deloach May 2000, Pearson.
---	--

Hafta	Haftalara Göre Ders Konuları	
1	Teorik	Derse giriş
2	Teorik	Analitik yöntemler
3	Teorik	Kurumsal risk yönetimine doğru evrim
4	Teorik	Riske maruz değer kavramı
5	Teorik	Alternatif korunma araçları – Futures/Forwards
6	Teorik	Arbitraj prensipleri ve vadeli işlem fiyatlama/değerleme
7	Teorik	Risklerin değerlendirilmesi ve strateji geliştirme
8	Ara Sınav (Vize)	Ara Sınav
9	Teorik	Opsiyon piyasaları ve risk yönetiminde kullanımı
10	Teorik	Opsiyon sözleşmeleri ve değerlendirme
11	Teorik	Takas sözleşmeleri ve firma içi kullanımı
12	Teorik	Alternatif korunma araçları-Factoring, alacak sigortası
13	Teorik	Kredi risk yönetimi
14	Teorik	Şirket çapında risk stratejisinin formülasyonu - Vaka Analizi
15	Teorik	Şirket çapında risk stratejisinin formülasyonu - Vaka Analizi
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	1	3	56
Ara Sınav	1	20	1	21



Dönem Sonu Sınavı	1	25	1	26
Toplam İş Yüğü (Saat)				103
Yuvarla [Toplam İş Yüğü (saat) / 25*] = AKTS Kredisi				4
*25 saatlik iş yüğü 1 AKTS olarak kabul edilmektedir.				

Dersin Öğrenme Çıktıları

1	Entelektüel kapasitesi yüksek, sosyal becerileri gelişmiş, pozitif düşünceye sahip, farklı ortam ve kurumlara adaptasyon becerisi olan bireyler olmak
2	Uluslararası platformlarda çalışabilecek nitelikte teknik donanım, esnek düşünce ve hareket yapısına ve çoklu dil becerisine sahip olmak
3	Küreselleşen iş dünyasının gerekleri doğrultusunda disiplinlerarası bir yaklaşımla işletme, ekonomi vb. alanlarından elde ettikleri temel bilgileri, kendilerine uluslararası ticaret ve finansman alanlarında uzmanlık yaratacak biçimde kullanabilmek
4	Mevcut konjonktürde küreselleşme olgusunun en yoğun olarak gözlemlendiği iki alan olan uluslararası ticaret ve finans piyasalarındaki dinamikleri izleyip analiz edebilmek
5	Proaktif bir yaklaşımla uluslararası ticaret ve finansman alanlarında bölgesel, ulusal ve uluslararası sorunları öngörüp ilgili kişi ve kurumları bilgilendirerek çözüm önerileri geliştirebilmek

Program Çıktıları (Uluslararası Ticaret ve Finans Programı)

1	Entelektüel kapasitesi yüksek, sosyal becerileri gelişmiş, pozitif düşünceye sahip, farklı ortam ve kurumlara adaptasyon becerisi olan bireyler olmak
2	Uluslararası platformlarda çalışabilecek nitelikte teknik donanım, esnek düşünce ve hareket yapısına ve çoklu dil becerisine sahip olmak
3	Küreselleşen iş dünyasının gerekleri doğrultusunda disiplinlerarası bir yaklaşımla işletme, ekonomi vb. alanlarından elde ettikleri temel bilgileri, kendilerine uluslararası ticaret ve finansman alanlarında uzmanlık yaratacak biçimde kullanabilmek
4	Proaktif bir yaklaşımla uluslararası ticaret ve finansman alanlarında bölgesel, ulusal ve uluslararası sorunları öngörüp ilgili kişi ve kurumları bilgilendirerek çözüm önerileri geliştirebilmek
5	Program gereği olarak nicel yeterlik ile birlikte analitik düşünme ve sentez yapabilme becerisine haiz olmak
6	Eğitim sırasında edindiği bilgi ve becerileri, mevcut piyasa koşullarının gereğine uygun olarak sürekli geliştirebilecek araştırmacı ve sorgulayıcı yapıya sahip olmak
7	Uluslararası ticaret ve finansmana ilişkin kuramların günümüz koşullarındaki geçerliliğini ve ilişkilerini tanımlayıp analiz edebilmek
8	Etkin bir iletişim kurabilecek düzeyde İngilizce bilgisine sahip olmanın yanında ikinci bir yabancı dile de bireysel koşulları ölçüsünde hâkim olabilmek
9	Uygulamada karşılaşılan mevcut ve olası sorunları çözmek için yönetme ve yönetilebilme vasıflarına sahip olmak
10	Yetkisi dahilinde yönetici pozisyonunda olduğu birimdeki çalışanların kişisel ve mesleki gelişimine katkıda bulunacak etkinlikleri organize edebilmek

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

	ÖÇ1	ÖÇ2	ÖÇ3	ÖÇ4	ÖÇ5
PÇ1	2	4	2	4	5
PÇ2	3	4	3	4	5
PÇ3	4	4	3	4	4
PÇ4	5	4	5	4	5
PÇ5	5	4	5	4	4
PÇ6	4	4	5	4	5
PÇ7	4	4	5	3	4
PÇ8	5	3	4	4	4
PÇ9	4	3	3	5	5
PÇ10	4	2	4	4	4

