

GENEL TANIM / GENERAL DESCRIPTION

Ders Adı / Course Name	Financial Risk Analysis / Financial Risk Analysis	
Ders Kodu / Course Code	9204067352016	
Ders Türü / Course Type		
Ders Seviyesi / Course Level	Second Cycle / Second Cycle	
Ders Akts Kredi / ECTS	6.00	
Haftalık Ders Saati (Kuramsal) / Course Hours For Week (Theoretical)	3.00	
Haftalık Uygulama Saati / Course Hours For Week (Objected)	0.00	
Haftalık Laboratuvar Saati / Course Hours For Week (Laboratory)	0.00	
Dersin Verildiği Yıl / Year	1	
Öğretim Sistemi / Teaching System	Evening Education / Evening Education	
Eğitim Dili / Education Language	Turkish / Turkish	
Ön Koşulu Olan Ders(ler) / Precondition Courses	Yok	
Amacı / Purpose	Bu dersin amacı öğrencilerin, finansal kurumların karşı karşıya kalabilecekleri piyasa, kredi, operasyonel gibi risklerin kaynaklarını, ölçüm yöntemlerini ve yöntemlerin değerlendirme işlemlerini anlamalarını sağlamaktır.	The objective of this course is to present to the students sufficient theoretical background on basic financial techniques and to prepare students in doing independent research project.
İçeriği / Content	Risk faktörlerinin tanımı, risk türleri , risk kaynakları, risk faktörlerinin modellenmesi, riske maruz değer, varyans kovaryans methodu, tarihi simulasyon, monte carlo simulasyon, bono fiyatlaması, getiri eğrileri, faiz modellemesi, kredi risk yönetimi, kredi türevleri, kredi risk yönetimi, muhasebe ve vergi risk yönetimi. Risk ve Vade Yapısı Faiz Oranını Nasıl Etkiler?	Investment Risk Management, Linear Risk Models, Nonlinear Risk Models, Advanced Risk Models, Credit Risk, Volatility and Liquidity Risks, Volatility and Basel Record.
Önerilen Diğer Hususlar / Recommended Other Considerations	Yok	
Staj Durumu / Internship Status	Yok	

<p>Kitap / Malzemesi / Önerilen Kaynaklar / Books / Materials / Recommended Reading</p>	<p>Mishkin, F. S. and Eakins, S. G (2009), Financial Markets and Institutions, 6th Ed., Pearson-Prentice Hall. Mishkin, F. S. (2007), The Economics of Money, Banking, and Financial Markets, 8th International Edition, Pearson-Addison Wesley.</p> <p>Howells, P. and Bain, K. (2008), The Economics of Money, Banking and Finance: A European Text, 4th Ed., Pearson-Prentice Hall.</p> <p>Steiner, B. (2002), Foreign, Exchange and Money Markets: Theory, Practice and Risk Management, Butterworth-Heinemann.</p> <p>Gregoriou, G. N., Hübner, G., Papageorgiou, N., and Rouah, N. (2005), Hedge Funds: Insights in Performance Measurement, Risk Analysis, and Portfolio Allocation, John Wiley & Sons. Levi, M. D. (2009), International Finance, 4th Edition, Routledge.</p> <p>Roberts, R. (2002), Wall Street The Markets Mechanisms and Players, The Economist. Parasız, İ. (2000), Para Banka ve Finansal Piyasalar, 7. Baskı, Ezgi Kitap Evi.</p> <p>Günal, M. (2007), Para Banka va Finansal Sistem, 2. Bskı, Yeni Dönem Yayını.</p> <p>Implementing Value at Risk, John Wiley & Sons, Best Philip, 1998.</p> <p>Jorion, P , Value at Risk, the New Benchmark for Controlling Market, Chicago, Irwin. 1997. Hasan S., Riske Maruz Değer Hesaplama Yöntemleri, 2004, Turhan Yayınevi</p>	<p>Mishkin, F. S. and Eakins, S. G (2009), Financial Markets and Institutions, 6th Ed., Pearson-Prentice Hall. Mishkin, F. S. (2007), The Economics of Money, Banking, and Financial Markets, 8th International Edition, Pearson-Addison Wesley.</p> <p>Howells, P. and Bain, K. (2008), The Economics of Money, Banking and Finance: A European Text, 4th Ed., Pearson-Prentice Hall.</p> <p>Steiner, B. (2002), Foreign, Exchange and Money Markets: Theory, Practice and Risk Management, Butterworth-Heinemann.</p> <p>Gregoriou, G. N., Hübner, G., Papageorgiou, N., and Rouah, N. (2005), Hedge Funds: Insights in Performance Measurement, Risk Analysis, and Portfolio Allocation, John Wiley & Sons. Levi, M. D. (2009), International Finance, 4th Edition, Routledge.</p> <p>Roberts, R. (2002), Wall Street The Markets Mechanisms and Players, The Economist. Parasız, İ. (2000), Para Banka ve Finansal Piyasalar, 7. Baskı, Ezgi Kitap Evi.</p> <p>Günal, M. (2007), Para Banka va Finansal Sistem, 2. Bskı, Yeni Dönem Yayını.</p> <p>Implementing Value at Risk, John Wiley & Sons, Best Philip, 1998.</p> <p>Jorion, P , Value at Risk, the New Benchmark for Controlling Market, Chicago, Irwin. 1997. Hasan S., Riske Maruz Değer Hesaplama Yöntemleri, 2004, Turhan Yayınevi</p>
<p>Öğretim Üyesi (Üyeleri) / Faculty Member (Members)</p>	<p>Doç. Dr. Nazif Çatık</p>	

ÖĞRENME ÇIKTILARI / LEARNING OUTCOMES

1	1.Finansal kavramları tanımlayabilme,	1.To be able to define financial concepts,
2	2.Temel düzeydeki finansal risk problemlerini çözebilme,	2.To be able to solve financial risk problems at basic level,
3	3.İleri finansal yöntemleri kullanabilme,	3.To be able to use advanced financial methods.

HAFTALIK DERS İÇERİĞİ / DETAILED COURSE OUTLINE

Hafta / Week					
	Teorik Dersler / Theoretical	Uygulama	Lab	Öğretim Yöntem ve Teknikleri/Teaching Methods Techniques	Ön Hazırlık / Preliminary
1	Derse Giriş				
	Introduction to the course				
2	Risk Yönetimi				
	Risk Management				
3	Lineer Risk Modelleri				
	Linear Risk Models				
4	Lineer Olmayan Risk Modelleri				
	Nonlinear Risk Models				
5	Lineer Olmayan Risk Modelleri				
	Nonlinear Risk Models				

	Teorik Dersler / Theoretical	Uygulama	Lab	Öğretim Yöntem ve Teknikleri/Teaching Methods Techniques	Ön Hazırlık / Preliminary
6	İleri Risk Modelleri				
	Advanced Risk Models				
7	Ara Sınav				
	Midterm exam				
8	İleri Risk Modelleri				
	Advanced Risk Models				
9	Kredi Yönetimi				
	Credit Risk				
10	Kredi Yönetimi				
	Credit Risk				
11	Kredi Yönetimi				
	Credit Risk				

	Teorik Dersler / Theoretical	Uygulama	Lab	Öğretim Yöntem ve Teknikleri/Teaching Methods Techniques	Ön Hazırlık / Preliminary
12	Dalgalanma ve Likidite Riskleri				
	Volatility and Liquidity Risks				
13	Dalgalanma ve Likidite Riskleri				
	Volatility and Liquidity Risks				
14	Dalgalanma ve Likidite Riskleri				
	Volatility and Liquidity Risks				
15	Basel Uzlaşmaları				
	Basel Record				
16	Final Sınavı				
	Final Exam				

DEĞERLENDİRME / EVALUATION

Yarıyıl (Yıl) İçi Etkinlikleri / Term (or Year) Learning Activities	Sayı / Number	Katkı Yüzdesi / Percentage of Contribution (%)
Ara Sınav / Midterm Examination	1	100
Toplam / Total:	1	100
Başarı Notuna Katkı Yüzdesi / Contribution to Success Grade(%):		40

Yarıyıl (Yıl) Sonu Etkinlikleri / End Of Term (or Year) Learning Activities	Sayı / Number	Katkı Yüzdesi / Percentage of Contribution (%)
Final Sınavı / Final Examination	1	100
Toplam / Total:	1	100
Başarı Notuna Katkı Yüzdesi / Contribution to Success Grade(%):		60

Etkinliklerinin Başarı Notuna Katkı Yüzdesi(%) Toplamı / Total Percentage of Contribution (%) to Success Grade:	100
Değerlendirme Tipi / Evaluation Type:	

İŞ YÜKÜ / WORKLOADS

Etkinlikler / Workloads	Sayı / Number	Süresi (Saat) / Duration (Hours)	Toplam İş Yüğü (Saat) / Total Work Load (Hour)
Bireysel Çalışma / Self Study	16	3.00	48.00
Derse Katılım / Attending Lectures	16	3.00	48.00
Ara Sınav / Midterm Examination	1	1.00	1.00
Final Sınavı için Bireysel Çalışma / Individual Study for Final Examination	1	30.00	30.00
Okuma / Reading	5	5.00	25.00
Final Sınavı / Final Examination	1	1.00	1.00
Ara Sınav için Bireysel Çalışma / Individual Study for Mid term Examination	1	20.00	20.00
Toplam / Total:	41	63.00	173.00

PROGRAM VE ÖĞRENME ÇIKTISI / PROGRAM LEARNING OUTCOMES

Öğrenme Çıktıları / Learning Outcomes	Program Çıktıları / Program Outcomes													
	1.1.1	1.1.2	1.1.3	1.1.4	1.1.5	1.1.6	1.1.7	1.1.8	1.1.9	1.1.10	1.1.11	1.1.12	1.1.13	1.1.14
1.1.Finansal kavramları tanımlayabilme, / 1.To be able to define financial concepts,	5	5	5	5					5	3	2	3	5	
2.2.Temel düzeydeki finansal risk problemlerini çözebilme, / 2.To be able to solve financial risk problems at basic level,	5		5	5				5	5	4	5	3	5	
3.3.İleri finansal yöntemleri kullanabilme, / 3.To be able to use advanced financial methods.	5		5	5				5	5	4	5	3	5	

Katkı Düzeyi / Contribution Level : 1-Çok Düşük / Very low, 2-Düşük / Low, 3-Orta / Moderate, 4-Yüksek / High, 5-Çok Yüksek / Very high