

Dersin Tanımı					
Adı	Kodu	Yarıyıl	T+U Saat	Kredi	AKTS
FİNANSAL RİSK VE TÜREV PİYASALAR	ITF4110837	Güz Dönemi	3+0	3	5
Ön Koşul Dersleri					
Önerilen Seçmeli Dersler					
Dersin Dili	İngilizce				
Dersin Seviyesi	Lisans				
Dersin Türü	Programa Bağlı Seçmeli				
Dersin Koordinatörü	Dr.Öğr.Üye. Ayşe Saime DÖNER				
Dersi Verenler	Prof.Dr. Mesut KARAKAŞ				
Dersin Yardımcıları					
Dersin Amacı	Bu ders opsiyon, forward kontratları, future kontratları ve swapları tanıtmayı amaçlamaktadır. Bu derse kaydolun öğrencilerden türev piyasaları finansal risk ile baş etmek için kullanabilmeleri beklenmektedir. Bu ders finansal türev ürünleri analiz etmek için değerli bilgiler sağlamaktadır.				
Dersin İçeriği	Bu ders; Giriş,Vadeli İşlemleri Kullanarak Riskten Korunma,Faizler,Forward ve Future Enstrümanlarının Fiyatlarının Belirlenmesi,Faize Dayalı Vadeli İşlemler,Swaplar, Menkul Kıymetleştirme ve Kriz,Vize,Opsiyonların Özellikleri,İşlem Stratejileri ve Binom Ağaçları,Hisse Senedi Opsiyonlarının Fiyatlaması,Borsa Endeksi, Döviz ve Vadeli İşlemler Üzerine Opsiyonlar,The Greeks,Finansal Risk Yönetimi Teknikleri ve Uygulamaları I,Finansal Risk Yönetimi Teknikleri ve Uygulamaları II; konularını içermektedir.				
Dersin Öğrenme Kazanımları				Öğretim Yöntemleri	Ölçme Yöntemleri
1. Finansal Risk Yönetiminin Temellerini tanımlayabilecektir.				10, 16, 6, 9	A
1.1. Finansal risk kavramının tanır ve türlerini ayırt eder					
1.2. Türevlerin modern finansal piyasalardaki rolünü analiz eder.					
2. Finansal risk türlerini tanımlayabilecektir.				10, 16, 6, 9	A
2.1. Piyasa riskini sınıflandırır ve yatırım portföyleri üzerindeki etkisini değerlendirir.					
2.2. Kredi riskini tanımlar ve değerlendirme ve yönetim stratejileri geliştirir					
3. Türev Araçlarını analiz edebilecektir.				10, 16, 6, 9	A
3.1. Vadeli ve vadeli işlem sözleşmelerinin özelliklerini ve uygulamalarını değerlendirir.					
3.2. Opsiyonları ve bunların riskten korunma ve spekülasyondaki rollerini eleştirel bir şekilde değerlendirir					
4. Risk yönetimi stratejilerini tanımlayabilecektir.				10, 16, 6, 9	A
4.1. Türev araçları kullanarak riskten korunma stratejilerini açıklar.					
4.2. Türev piyasalarda spekülasyon ve arbitraj tekniklerini değerlendirir.					
5. Türev İşlemlerde Düzenleyici Çerçeve ve Etik Düşünceleri inceleyebilecektir.				10, 16, 6, 9	A
5.1. Türev piyasaları izlemede düzenleyici kurumların rolünün inceler.					
5.2. Türev işlemlerde ve risk yönetimi uygulamalarında etik zorlukların tartışır.					
Öğretim Yöntemleri	10: Tartışma Yöntemi, 16: Soru - Cevap Tekniği , 6: Deneyimle Öğrenme Modeli, 9: Anlatım Yöntemi				
Ölçme Yöntemleri	A: Klasik Yazılı Sınav				
Ders Akışı					
Sıra	Konular	Ön Hazırlık			
1	Giriş				
2	Vadeli İşlemleri Kullanarak Riskten Korunma				
3	Faizler				
4	Forward ve Future Enstrümanlarının Fiyatlarının Belirlenmesi				
5	Faize Dayalı Vadeli İşlemler				
6	Swaplar, Menkul Kıymetleştirme ve Kriz				
7	Vize				
8	Opsiyonların Özellikleri				
9	İşlem Stratejileri ve Binom Ağaçları				
10	Hisse Senedi Opsiyonlarının Fiyatlaması				
11	Borsa Endeksi, Döviz ve Vadeli İşlemler Üzerine Opsiyonlar				
12	The Greeks				
13	Finansal Risk Yönetimi Teknikleri ve Uygulamaları I				
14	Finansal Risk Yönetimi Teknikleri ve Uygulamaları II				
Değerlendirme Yöntemleri		Sınava Katkısı			
Ara Sınav		40			
Genel Sınav		60			

Kaynaklar

John C. Hull, "Fundamentals of Futures and Options Markets", Küresel Edisyon, 8/E, ISBN: 9781292155036 Don M. Chance, Robert Brooks, "An Introduction to Derivatives and Risk Management", 10/E, ISBN: 9781305104969