

| Dersin Tanımı | | | | | |
|-----------------------------------------------------------------------------------------|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|-----------------------|----------|---------------------------|-------------------------|
| Adı | Kodu | Yarıyıl | T+U Saat | Kredi | AKTS |
| FİNANSAL RİSK VE TÜREV PİYASALAR | BAN3156350 | Güz Dönemi | 3+0 | 3 | 5 |
| Ön Koşul Dersleri | | | | | |
| Önerilen Seçmeli Dersler | | | | | |
| Dersin Dili | Türkçe | | | | |
| Dersin Seviyesi | Lisans | | | | |
| Dersin Türü | Zorunlu | | | | |
| Dersin Koordinatörü | Prof.Dr. Hasan DİNÇER | | | | |
| Dersi Verenler | Prof.Dr. Hasan DİNÇER | | | | |
| Dersin Yardımcıları | | | | | |
| Dersin Amacı | Finansal riskten korunma unsuru olan türev ürünleri öğretmektir. | | | | |
| Dersin İçeriği | Bu ders; Vadeli Piyasalar –Spot Piyasalar ,Risk Yönetimi ve Vadeli Piyasalar ,Risk Yönetiminde Vadeli Piyasaların Gelişimi,Vadeli İşlem Piyasalarının İşlevleri ,Vadeli İşlem Piyasalarında Temel Stratejiler ,Vadeli İşlem Piyasalarında Temel Stratejiler ,Forward Sözleşmeler ,Futures Sözleşmeler ,Opsiyon Piyasaları: Temel Kavramlar-Opsiyon Fiyatlaması ,Opsiyon Stratejileri ,İleri Opsiyon Stratejileri I ,İleri Opsiyon Stratejileri II ,Swap Sözleşmeleri ve Yöntemleri ,Türkiye’de Vadeli Piyasaların Gelişimi ve İşleyişi ,Dünyada Vadeli Piyasaların Son Durumu ; konularını içermektedir. | | | | |
| Dersin Öğrenme Çıktıları | | | | Öğretim Yöntemleri | Ölçme Yöntemleri |
| 1.1. Vadeli piyasaların temel işlevini açıklar. | | | | | |
| 1.2. Vadeli piyasalar ile spot piyasalar arasındaki farkları açıklar. | | | | | |
| 1.3. Tezgahüstü ve organize türev piyasaları açıklar. | | | | | |
| 6.2.Türev ürünlerin fiyatlama modelleri ile fiyat hesaplar. | | | | | |
| 1. Vadeli piyasaları değerlendirebilecektir. | | | | 1, 2 | A, C |
| 2. Opsiyon stratejilerini çözümlenebilecektir. | | | | 1, 2 | A, C |
| 2.1. Opsiyon stratejilerini açıklar. | | | | | |
| 2.2. Hangi stratejiyi kullanacağını yorumlar. | | | | | |
| 3. Vadeli işlem piyasalarında finansal risk ve hedging işlemlerini yorumlayabilecektir. | | | | 1, 2 | A, C |
| 3.1. Vadeli işlem sözleşmelerinin unsurlarını açıklar. | | | | | |
| 3.2. Vadeli işlem sözleşmeleri ile hedging işlemlerini yorumlar. | | | | | |
| 3.3. Vadeli işlem piyasalarının finansal riskten korunmadaki rolünü açıklar. | | | | | |
| 4. Risk yönetiminde kullanılan türev ürünlerini karşılaştırabilecektir. | | | | 1, 2 | A, C |
| 4.1. Forward sözleşmeleri açıklar. | | | | | |
| 4.2. Futures sözleşmeleri açıklar. | | | | | |
| 4.3. Opsiyon sözleşmeleri açıklar. | | | | | |
| 4.4. Swap sözleşmeleri açıklar. | | | | | |
| 5. Türev ürünlerin işleyişini ve nasıl kullanıldığını değerlendirebilecektir. | | | | 1, 2 | A, C |
| 5.1. Türev ürünlerin kullanım amaçlarını açıklar. | | | | | |
| 5.2. Türev ürünlerin işleyişini açıklar. | | | | | |
| 6. Türev ürünleri fiyatlama modellerini değerlendirebilecektir. | | | | 1, 2 | A, C |
| 6.1. Türev ürünlerin fiyatlama modellerini açıklar. | | | | | |
| Öğretim Yöntemleri | 1: Anlatım, 2: Soru - Cevap | | | | |
| Ölçme Yöntemleri | A: Yazılı sınav, C: Ödev | | | | |
| Ders Akışı | | | | | |
| Sıra | Konular | Ön Hazırlık | | | |
| 1 | Vadeli Piyasalar –Spot Piyasalar | | | | |
| 2 | Risk Yönetimi ve Vadeli Piyasalar | | | | |
| 3 | Risk Yönetiminde Vadeli Piyasaların Gelişimi | | | | |
| 4 | Vadeli İşlem Piyasalarının İşlevleri | | | | |
| 5 | Vadeli İşlem Piyasalarında Temel Stratejiler | | | | |
| 6 | Forward Sözleşmeler | | | | |
| 7 | Futures Sözleşmeler | | | | |
| 8 | Opsiyon Piyasaları: Temel Kavramlar-Opsiyon Fiyatlaması | | | | |
| 9 | Opsiyon Stratejileri | | | | |
| 10 | İleri Opsiyon Stratejileri I | | | | |
| 11 | İleri Opsiyon Stratejileri II | | | | |
| 12 | Swap Sözleşmeleri ve Yöntemleri | | | | |
| 13 | Türkiye’de Vadeli Piyasaların Gelişimi ve İşleyişi | | | | |
| 14 | Dünyada Vadeli Piyasaların Son Durumu | | | | |
| Değerlendirme Yöntemleri | | Sınava Katkısı | | | |
| Ara Sınav | | 40 | | | |
| Genel Sınav | | 60 | | | |

Kaynaklar

Yalçın Karatepe, Türev Piyasalar, Siyasal Bilgiler Fakültesi Yayını, 2000. Doç.Dr. Nurgül Chambers, Türev Piyasalar, İstanbul, 1998. Robert W. Kolb, Futures, Options and Swaps, Fouth Edition, Blackwell Publishing, 2003.