

ABDULLAH GÜL ÜNİVERSİTESİ
YÖNETİM BİLİMLERİ FAKÜLTESİ
İŞLETME BÖLÜMÜ
DERS TANIM VE UYGULAMA BİLGİLERİ

Dersin Adı	Kodu	Yarıyılı	T+U Saat	Kredisi	AKTS
RİSK YÖNETİMİ	BA323	GÜZ	3 + 0	3	5

Ön Koşul Dersleri YOK

Dersin Türü	Seçmeli
Dersin Dili	İngilizce
Dersin Koordinatörü	Prof. Dr Erk HACIHASANOĞLU
Dersi Verenler	Prof. Dr. Erk HACIHASANOĞLU
Dersin Yardımcıları	Ranan TORUN
Dersin Amacı	Risk yönetiminin temel teori ve uygulamalarının, risk ölçüm tekniklerinin ve risk azaltma yöntemlerinin öğrenilmesidir
Dersin Öğrenme Çıktıları	- Var olan finansal risklerin, yani kredi, piyasa ve likidite risklerinin tanıtılması - Risk ölçümlerindeki kullanılan geleneksel ve modern tekniklerin değerlendirilmesi - Finansal varlıkların risklerinin hesaplanması ve riske maruz değer konsepti - Risk kontrolü ile borç yönetimi, sermaye dağılımı ve risk tabanlı performans ölçümlerinin anlatılması - Küresel finansal kriz ve arkasındaki sebep ve sonuçlarının tartışılması
Dersin İçeriği	- Finansal piyasalar ve elemanlar - Riskin tanımı ve riskin yönetimi - Riskin çeşitleri - Piyasa riski, kaynakları ve çeşitleri - Döviz kuru riski, faiz oranı riski ve diğer piyasa riski çeşitleri - Piyasa riskinin ölçümü ve vade yapısı - Aralık analizi ve Oynaklık - Riske maruz değer - Senaryo analizi ve stress testi - Kredi Riski (Tanım, kaynakları ve tipleri) - Kredi riskinin ölçümü ve riske maruziyetin ölçümü - Dışsal kredi değerlendirme ve iflas olasılığı - CAMEL değerlendirme ve kredi riske maruz değer - Kredi türleri ve cari finansal krizdeki rolü - Likidite riski (Tanım, kaynakları ve tipleri) - Operasyonel risk (Tanım, kaynakları ve tipleri) - Risk kontrolü - Aktif Pasif Yönetimi - Türev araçlar kullanarak çeşitlendirme ve riski azaltma - Risk limitleri ve sermaye dağıtımı - Riske göre uyarlanmış performans ölçümleri

HAFTALIK KONULAR VE İLGİLİ ÖN HAZIRLIK SAYFALARI

Hafta	Konular	Ön Hazırlık
1	Finansal piyasalar ve elemanlar Riskin tanımı ve riskin yönetimi	The relevant chapters from suggested readings
2	Riskin tanımı ve riskin yönetimi	The relevant chapters from suggested readings
3	Piyasa riski, kaynakları ve çeşitleri	The relevant chapters from suggested readings
4	Döviz kuru riski, faiz oranı riski ve diğer piyasa riski çeşitleri	The relevant chapters from suggested readings
5	LFW	The relevant chapters from suggested readings
6	Piyasa riskinin ölçümü ve vade yapısı Aralık analizi ve Oynaklık	The relevant chapters from suggested readings

7	Riske maruz değer Senaryo analizi ve stress testi	The relevant chapters from suggested readings
8	Ara Sınav	
9	Ara Tatil	
10	Kredi Riski (Tanım, kaynakları ve tipleri) Kredi riskinin ölçümü ve riske maruziyetin ölçümü	The relevant chapters from suggested readings
11	Dışsal kredi değerlendirme ve iflas olasılığı CAMEL değerlendirme ve kredi riske maruz değer Kredi türevleri ve cari finansal krizdeki rolü	The relevant chapters from suggested readings
12	Likidite riski (Tanım, kaynakları ve tipleri)	The relevant chapters from suggested readings
13	Operasyonel risk (Tanım, kaynakları ve tipleri) Risk kontrolü	The relevant chapters from suggested readings
14	Aktif Pasif Yönetimi Türev araçlar kullanarak çeşitlendirme ve riski azaltma	The relevant chapters from suggested readings
15	Risk limitleri ve sermaye dağıtımı Riske göre uyarlanmış performans ölçümleri	The relevant chapters from suggested readings
16	Yıl sonu Sınavı	

KAYNAKLAR

Ders Notu	Bu derse ait ders notları (tahtaya yazılacak olan)
Diğer Kaynaklar	Ders için tek bir ders kitabı belirlenmemiştir. Öğrenciler ders sırasında işlenen içeriği dikkatle almalıdır Yardımcı Kitaplar: • "Investments", Bodie, Kane and Marcus. • "Risk Management in Banking", J. Bessis, Wiley, 1998. • "Value-at-Risk", P., Jorion, McGraw Hill, 2000. • "Options, Futures and Other Derivatives", John C Hull, Prentice Hall Business Publishing, 2000. • "RiskMetricsTM Technical Document", RiskMetrics, 1996. (www.riskmetrics.com) • "CreditMetricsTM Technical Document", RiskMetrics, 1997. (www.riskmetrics.com) • "Black Swan", Nassim Nicholas Taleb, Random House, 2007. • "Beyond Value at Risk", K Dowd, Wiley, 1998.

MATERYAL PAYLAŞIMI

Dökümanlar	Bu derse ait ders notları.
Ödevler	Semester boyunca 1 adet grup çalışması ödevi yapılacaktır
Sınavlar	1 Ara Sınav ve 1 Final Sınavı

DEĞERLENDİRME SİSTEMİ

YARIYIL İÇİ ÇALIŞMALARI	SAYISI	KATKI PAYI
Ara Sınav	1	25
Katılım	14	10
Grup durum çalışması	1	25
TOPLAM		60
Yılıçının Başarıya Oranı		60
Finalin Başarıya Oranı	1	40
TOPLAM		100

Ders Kategorisi

Matematik ve İstatistik	%60
Sosyal Bilimler	%40

DERSİN ÖĞRENİM ÇIKTILARININ PROGRAM YETERLİLİKLERİ İLE İLİŞKİSİ						
No	Program Yeterlilikleri	Katkı Düzeyi				
		1	2	3	4	5
1	Pazarlama, insan kaynakları yönetimi, üretim yönetimi, muhasebe ve finans gibi işletmenin alt alanlarında bilgi toplamak ve bu bilgiyi firmanın bütün misyon ve vizyonuna entegre etmek ve uygulamak.					x
2	Bilgi teknolojisi ve araştırma yöntemlerini kullanarak; veriyi edinme, yorumlama, sentezleme ve sonuçları karar vermede kullanarak, kritik ve stratejik düşünceyi iş problemlerini çözme ve analiz etmede uygulamak.				x	
3	Küreselleşmenin şirketler, insanlar ve ulusal ekonomiler üzerindeki etkisini farklı hukuki, siyasi ve ekonomik sistemleri göz önünde bulundurarak anlamak.			x		
4	Daha iyi ürün, hizmet ve süreç yaratmada inovasyonun rolünü anlamak.	x				
5	Yazılı profesyonel iletişimde ve resmi sözlü sunumlarda yeterlilik gösterme yeteneği.	x				
6	Liderlik yeteneklerine sahip olma ve grup görevlerini yerine getirmede takım oluşturma ve işbirlikçilik yeteneklerini kullanma.	x				
7	İş yerlerindeki hukuki ve etik sorunları tanımak, bu sorunların potansiyel sonuçlarının farkında olmak ve bunlara alternatif çözümler üretmek.			x		
8	Örgütsel kapsamda, kararlarda ve iş uygulamalarında sürdürülebilirlik ve kurumsal sosyal sorumluluk kavramlarını anlamak.	x				
9	Devamlı olarak profesyonel, saygılı, dürüst, adil ve mantıklı bir biçimde davranmak ve etik prensipleri ve mantıksal akıl yürütmeyi iş kararlarını almak ve doğrulamak için kullanmak.				x	

AKTS / İŞ YÜKÜ TABLOSU			
Etkinlikler	Etkinlikler	Süresi (Saat)	Toplam İş Yüğü
Ders Süresi (Sınav haftası dahildir: 16x toplam ders saati)	16	3	48
Sınıf Dışı Ders Çalışma Süresi (Ön çalışma, pekiştirme)	16	2	32
İnternette tarama, kütüphane çalışması	16	1	16
Sunum	1	25	25
Arasınavlar	1	15	15
Yarıyıl Sonu Sınavı	1	20	20
Toplam İş Yüğü			156
Toplam İş Yüğü / 30			156/30
Dersin AKTS Kredisi			5