

Ders Bilgi Formu (Türkçe)					
Ders Adı: İşletmelerde Finansal Risk Yönetimi			Bölüm/Program/ABD İşletme		
Kredi 5	Yıl-Dönem 2012-2013/Bahar	Ders Kodu İŞL	Ders Düzeyi Lisans	Seçmeli/Zorunlu Seçmeli	Öğretim Dili Türkçe
Saatler/Kredi		*Öğretim Elemanı: Doç. Dr. Erkan POYRAZ (poyraz@mu.edu.tr) <small>*Öğretim elemanı adı yalnızca bilgi ve iletişim amaçlı olarak verilmiştir. Her bir derse öğretim elemanı atanması, dönem başında yönetim kurulu kararı ile yapılır.</small>			
T 3	U 0	L 0	K 3		
Öğretim Yöntem ve Teknikleri: Anlatım, soru-cevap, tartışma					
Ders Amaçları: Riskten korunma tekniklerinin analiz edilmesi amaçlanmaktadır.					
Ders İçeriği:					
I. Hafta	Finans Literatüründe Risk Kavramı ve Risk Sınıflandırması				
II. Hafta	Riskin Ölçülmesi				
III. Hafta	Portföy Kavramı, Klasik ve Modern Portföy Kuramları				
IV. Hafta	Portföy Riskinin Ölçülmesi				
V. Hafta	Değişim Katsayısı Tanımı, Anlamı ve Risk Yönetiminde Kullanımı				
VI. Hafta	Sermaye Varlıklarını Fiyatlandırma Modeli (CAPM)				
VII. Hafta	Finansal Varlık Pazar Doğrusu Analizi				
VIII. Hafta	Ara Sınav				
IX. Hafta	Sermaye Pazarı Doğrusunun Analizi (Etkin Portföy, Etkin Sınır, Ödünç Alan ve Veren Portföy Analizi)				
X. Hafta	Faiz Oranı Riski ve Ölçülmesi (Durasyon Analizi)				
XI. Hafta	Durasyon Gap'ı Hesaplamaları				
XII. Hafta	Riskten Korunma Yöntemlerinden Aktif Pasif Yönetimi				
XIII. Hafta	Kur Riski ve Korunma Yolları				
XIV. Hafta	Riske Maruz Değer (VAR) Analizi				
XV. Hafta	VAR Analizi (Devam)				
Beklenen Öğrenme Kazanımları: Dersin sonunda öğrenci; 1. Riski tanımlar. 2. Farklı risk türlerini kavrar. 3. Risk türlerinden korunma yollarını analiz eder.					
Ölçme ve Değerlendirme Yöntem(ler)i: Ara Sınav: %40, Yarıyıl Sonu Sınavı: %60					
Ders Kitabı: Evren BOLGÜN, Risk Yönetimi, Skala Yayıncılık, 2005					
Önerilen Kaynaklar: Baha KARAN, Yatırım Analizi ve Portföy Yönetimi, Gazi Kitabevi, Ankara, 2004 Öztin AKGÜÇ, Banka Yönetimi ve Performans Analizi, Arayış Basımevi, 2007					
Ön/Yan Koşulları:					