

GENEL TANIM / GENERAL DESCRIPTION

Ders Adı / Course Name	Risk Modeling and Analysis / Risk Modeling and Analysis	
Ders Kodu / Course Code	FNB618	
Ders Türü / Course Type		
Ders Seviyesi / Course Level		
Ders Akts Kredi / ECTS	8.00	
Haftalık Ders Saati (Kuramsal) / Course Hours For Week (Theoretical)	0.00	
Haftalık Uygulama Saati / Course Hours For Week (Objected)	0.00	
Haftalık Laboratuar Saati / Course Hours For Week (Laboratory)	0.00	
Dersin Verildiği Yıl / Year	1	
Öğretim Sistemi / Teaching System	Daytime Class / Daytime Class	
Eğitim Dili / Education Language		
Ön Koşulu Olan Ders(ler) / Precondition Courses	yok	none
Amacı / Purpose	İç denetim ve risk yönetimi konusunda detaylı bilgi vermenin yanı sıra iç denetimin işletmedeki yeri, iç denetimin amaçları, iç denetim organizasyonun oluşturulması, iç denetim faaliyetlerinin yürütülmesi ve iç denetim faaliyet sonuçlarının raporlanması konularında uygulamalı olarak konuya açıklık getirmektedir.	In addition to providing detailed information on internal auditing and risk management, the course aims to shed light on the role of internal auditing within the organization, the objectives of internal auditing, the establishment of the internal audit function, the execution of internal audit activities, and the reporting of internal audit findings.
İçeriği / Content	İç denetim ve risk yönetimi konusunda detaylı bilgi vermenin yanı sıra iç denetimin işletmedeki yeri, iç denetimin amaçları, iç denetim organizasyonun oluşturulması, iç denetim faaliyetlerinin yürütülmesi ve iç denetim faaliyet sonuçlarının raporlanması konularında uygulamalı olarak konuya açıklık getirmektedir.	In addition to providing detailed information on internal auditing and risk management, the course aims to shed light on the role of internal auditing within the organization, the objectives of internal auditing, the establishment of the internal audit function, the execution of internal audit activities, and the reporting of internal audit findings.
Önerilen Diğer Hususlar / Recommended Other Considerations	yok	none
Staj Durumu / Internship Status	yok	none
Kitabı / Malzemesi / Önerilen Kaynaklar / Books / Materials / Recommended Reading	yok	none
Öğretim Üyesi (Üyeleri) / Faculty Member (Members)		

ÖĞRENME ÇIKTILARI / LEARNING OUTCOMES

1	Risk yönetimi kavramlarını anlayarak farklı risk türlerini tanımlama ve sınıflandırma yeteneği kazanma.	Understand risk management concepts to identify and classify different types of risks.
2	Finansal risk modelleri oluşturarak finansal piyasalardaki belirsizlikleri analiz etme ve ölçme becerisi geliştirme.	Develop the ability to create financial risk models to analyze and measure uncertainties in financial markets.
3	Stokastik süreçler ve simülasyon tekniklerini kullanarak risklerin olasılığını ve etkilerini tahmin etme yeteneği edinme.	Acquire the capability to forecast the probabilities and impacts of risks using stochastic processes and simulation techniques.
4	Portföy riskini değerlendirerek risk-getiri ilişkilerini	Analyze risk-return relationships by assessing portfolio risk and return.
5	Riskleri değerlendirmek ve azaltmak için istatistiksel yöntemler ve nicel teknikleri uygulamada uzmanlık kazanmak	Gain proficiency in applying statistical methods and quantitative techniques to assess and mitigate risks.

HAFTALIK DERS İÇERİĞİ / DETAILED COURSE OUTLINE

Hafta / Week					
1	Teorik Dersler / Theoretical	Uygulama	Lab	Öğretim Yöntem ve Teknikleri/Teaching Methods Techniques	Ön Hazırlık / Preliminary
	Analitik yöntemler				
	Analytical Methods				
2	Teorik Dersler / Theoretical	Uygulama	Lab	Öğretim Yöntem ve Teknikleri/Teaching Methods Techniques	Ön Hazırlık / Preliminary
	Kurumsal risk yönetimine doğru evrim				
	Evolution towards Enterprise Risk Management				
3	Teorik Dersler / Theoretical	Uygulama	Lab	Öğretim Yöntem ve Teknikleri/Teaching Methods Techniques	Ön Hazırlık / Preliminary
	İç Denetimin Kapsamı ve Türleri				
	Scope and Types of Internal Audit				
4	Teorik Dersler / Theoretical	Uygulama	Lab	Öğretim Yöntem ve Teknikleri/Teaching Methods Techniques	Ön Hazırlık / Preliminary
	Riske maruz değer kavramı				
	Concept of Value at Risk				
5	Teorik Dersler / Theoretical	Uygulama	Lab	Öğretim Yöntem ve Teknikleri/Teaching Methods Techniques	Ön Hazırlık / Preliminary
	Alternatif korunma araçları				
	Alternative Hedging Instruments				

6	Teorik Dersler / Theoretical	Uygulama	Lab	Öğretim Yöntem ve Teknikleri/Teaching Methods Techniques	Ön Hazırlık / Preliminary
	Risk Yönetimi 1				
	Risk Management 1				
7	Teorik Dersler / Theoretical	Uygulama	Lab	Öğretim Yöntem ve Teknikleri/Teaching Methods Techniques	Ön Hazırlık / Preliminary
	Risk Yönetimi 2				
	Risk Management 2				
8	Teorik Dersler / Theoretical	Uygulama	Lab	Öğretim Yöntem ve Teknikleri/Teaching Methods Techniques	Ön Hazırlık / Preliminary
	Ara Sınav				
	Midterm Exam				
9	Teorik Dersler / Theoretical	Uygulama	Lab	Öğretim Yöntem ve Teknikleri/Teaching Methods Techniques	Ön Hazırlık / Preliminary
	Risk Yönetimi 3				
	Risk Management 3				
10	Teorik Dersler / Theoretical	Uygulama	Lab	Öğretim Yöntem ve Teknikleri/Teaching Methods Techniques	Ön Hazırlık / Preliminary
	Arbitraj prensipleri ve vadeli işlem fiyatlama/değerleme				
	Arbitrage Principles and Futures Pricing/Valuation				
11	Teorik Dersler / Theoretical	Uygulama	Lab	Öğretim Yöntem ve Teknikleri/Teaching Methods Techniques	Ön Hazırlık / Preliminary
	Opsiyon piyasaları ve risk yönetiminde kullanımı				
	Option Markets and their Use in Risk Management				

12	Teorik Dersler / Theoretical	Uygulama	Lab	Öğretim Yöntem ve Teknikleri/Teaching Methods Techniques	Ön Hazırlık / Preliminary
	Opsiyon sözleşmeleri ve değerlendirme				
	Option Contracts and Valuation				
13	Teorik Dersler / Theoretical	Uygulama	Lab	Öğretim Yöntem ve Teknikleri/Teaching Methods Techniques	Ön Hazırlık / Preliminary
	İlternatif korunma araçları-Factoring, alacak sigortası				
	Alternative Hedging Instruments - Factoring, Accounts Receivable Insurance				
14	Teorik Dersler / Theoretical	Uygulama	Lab	Öğretim Yöntem ve Teknikleri/Teaching Methods Techniques	Ön Hazırlık / Preliminary
	Şirket çapında risk stratejisinin formülasyonu- Vaka Analizi				
	Formulating Company-Wide Risk Strategy - Case Analysis				
15	Teorik Dersler / Theoretical	Uygulama	Lab	Öğretim Yöntem ve Teknikleri/Teaching Methods Techniques	Ön Hazırlık / Preliminary
	Final Sınavı				
	Final Sınavı				

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)
Ara Sınav / Midterm Examination	40	2.00	80.00
Final Sınavı / Final Examination	60	2.00	120.00
Toplam / Total:	100	4.00	200.00
Dersin AKTS Kredisi = Toplam İş Yüğü (Saat) / 25.00 (Saat/AKTS) = 200.00/25.00 = 8.00 ~ 8.00 / Course ECTS Credit = Total Workload (Hour) / 25.00 (Hour / ECTS) = 200.00 / 25.00 = 8.00 ~ 8.00			

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	1.1.15
1.Risk yönetimi kavramlarını anlayarak farklı risk türlerini tanımlama ve sınıflandırma yeteneği kazanma. / Understand risk management concepts to identify and classify different types of risks.	5	5	5	5	4	4	5	5	5	5	5	4	4	5	5
2.Finansal risk modelleri oluşturarak finansal piyasalardaki belirsizlikleri analiz etme ve ölçme becerisi geliştirme. / Develop the ability to create financial risk models to analyze and measure uncertainties in financial markets.	5	5	5	5	5	5	5	4	4	5	5	5	5	5	
3.Stokastik süreçler ve simülasyon tekniklerini kullanarak risklerin olasılığını ve etkilerini tahmin etme yeteneği edinme. / Acquire the capability to forecast the probabilities and impacts of risks using stochastic processes and simulation techniques.	4	4	4	5	5	5	5	5	5	4	4	5	5	5	5
4.Portföy riskini değerlendirerek risk-getiri ilişkilerini / Analyze risk-return relationships by assessing portfolio risk and return.	5	5	5	4	4	4	5	5	5	5	4	4	5	5	5
5.Riskleri değerlendirmek ve azaltmak için istatistiksel yöntemler ve nicel teknikleri uygulamada uzmanlık kazanmak / Gain proficiency in applying statistical methods and quantitative techniques to assess and mitigate risks.	4	4	4	5	5	5	5	4	4	5	5	5	4	4	5

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