

## GENEL TANIM / GENERAL DESCRIPTION

|                                                                                   |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                   |                                                                                                                                                                                                                                                                                                        |
|-----------------------------------------------------------------------------------|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| Ders Adı / Course Name                                                            | Financial Risk Analysis / Financial Risk Analysis                                                                                                                                                                                                                                                                 |                                                                                                                                                                                                                                                                                                        |
| Ders Kodu / Course Code                                                           | EBNF306                                                                                                                                                                                                                                                                                                           |                                                                                                                                                                                                                                                                                                        |
| Ders Türü / Course Type                                                           |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                   |                                                                                                                                                                                                                                                                                                        |
| Ders Seviyesi / Course Level                                                      | Bachelor / Bachelor                                                                                                                                                                                                                                                                                               |                                                                                                                                                                                                                                                                                                        |
| Ders Akts Kredi / ECTS                                                            | 5.00                                                                                                                                                                                                                                                                                                              |                                                                                                                                                                                                                                                                                                        |
| Haftalık Ders Saati (Kuramsal) / Course Hours For Week (Theoretical)              | 3.00                                                                                                                                                                                                                                                                                                              |                                                                                                                                                                                                                                                                                                        |
| Haftalık Uygulama Saati / Course Hours For Week (Objected)                        | 0.00                                                                                                                                                                                                                                                                                                              |                                                                                                                                                                                                                                                                                                        |
| Haftalık Laboratuar Saati / Course Hours For Week (Laboratory)                    | 0.00                                                                                                                                                                                                                                                                                                              |                                                                                                                                                                                                                                                                                                        |
| Dersin Verildiği Yıl / Year                                                       | 3                                                                                                                                                                                                                                                                                                                 |                                                                                                                                                                                                                                                                                                        |
| Öğretim Sistemi / Teaching System                                                 | Daytime Class / Daytime Class                                                                                                                                                                                                                                                                                     |                                                                                                                                                                                                                                                                                                        |
| Eğitim Dili / Education Language                                                  | Turkish / Turkish                                                                                                                                                                                                                                                                                                 |                                                                                                                                                                                                                                                                                                        |
| Ön Koşulu Olan Ders(ler) / Precondition Courses                                   |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                   |                                                                                                                                                                                                                                                                                                        |
| Amacı / Purpose                                                                   | Finansal Risk Analizi dersinin temel amacı; finansal piyasalarda ortaya çıkabilecek riskleri tanımlanması, ölçülmesi ve riskten korunma için gerekli finansal enstrümanlarının nasıl işlediğinin öğrenilmesidir.                                                                                                  | The main purpose of the Financial Risk Analysis course is; to define and measure the risks that may arise in the financial markets and to learn how the necessary financial instruments for hedging.                                                                                                   |
| İçeriği / Content                                                                 | Finansal piyasalarda risklerin tanımlanması<br>Bankacılık sektörü risklerinin incelenmesi<br>Finansal tablo analizi ile risklerin tanınması<br>Finansal riskten korunma için kullanılabilecek finansal marketlerin ve enstrümanların tanınması<br>Gerçek piyasa işlemleri ile örneklendirme metotları ile öğrenme | Identifying risks in financial markets<br>Examination of banking sector risks<br>Recognition of risks with financial statement analysis<br>Recognition of financial markets and instruments that can be used for financial risk hedging<br>Learning with real market transactions and sampling methods |
| Önerilen Diğer Hususlar / Recommended Other Considerations                        |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                   |                                                                                                                                                                                                                                                                                                        |
| Staj Durumu / Internship Status                                                   |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                   |                                                                                                                                                                                                                                                                                                        |
| Kitabı / Malzemesi / Önerilen Kaynaklar / Books / Materials / Recommended Reading |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                   |                                                                                                                                                                                                                                                                                                        |
| Öğretim Üyesi (Üyeleri) / Faculty Member (Members)                                | Dr. Öğretim Üyesi Nuri SEVGİN                                                                                                                                                                                                                                                                                     |                                                                                                                                                                                                                                                                                                        |

### ÖĞRENME ÇIKTILARI / LEARNING OUTCOMES

|   |                                                                                                          |                                                                                                                       |
|---|----------------------------------------------------------------------------------------------------------|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 1 | Risk konsepti, analiz yöntemleri, ve risk enformasyonu kullanımını genel olarak anlama yetisi kazanır.   | Gain a general understanding of the concept of risk, analysis methods, and the use of risk information.               |
| 2 | Finansal piyasalardan ve finansal kurumlardan edinilen bilgileri tanımlama ve yorumlama becerisi kazanır | Gains the ability to define and interpret the information obtained from financial markets and financial institutions. |
| 3 | Finansal varlık ve portföy risklerini kavrar, yorumlar ve hesaplar.                                      | Understands, interprets and calculates financial asset and portfolio risks.                                           |
| 4 | Finansal risk analizinde kullanılan modern teknikleri gerçek hayat finansal problemlerine uygular.       | Applies modern techniques used in financial risk analysis to real life financial problems.                            |

### HAFTALIK DERS İÇERİĞİ / DETAILED COURSE OUTLINE

| Hafta / Week |                                                                                  |          |     |                                                          |                           |
|--------------|----------------------------------------------------------------------------------|----------|-----|----------------------------------------------------------|---------------------------|
| 1            | Teorik Dersler / Theoretical                                                     | Uygulama | Lab | Öğretim Yöntem ve Teknikleri/Teaching Methods Techniques | Ön Hazırlık / Preliminary |
|              | Finansal Risk Analizi kavramına ve dersin içeriğine genel bakış                  |          |     |                                                          |                           |
|              | Overview of the concept of Financial Risk Analysis and the content of the course |          |     |                                                          |                           |
| 2            | Teorik Dersler / Theoretical                                                     | Uygulama | Lab | Öğretim Yöntem ve Teknikleri/Teaching Methods Techniques | Ön Hazırlık / Preliminary |
|              | Risklerin ölçülmesi, sınıflandırılması ve risk yönetimi uygulamaları             |          |     |                                                          |                           |
|              | Measuring, classifying risks and risk management practices                       |          |     |                                                          |                           |
| 3            | Teorik Dersler / Theoretical                                                     | Uygulama | Lab | Öğretim Yöntem ve Teknikleri/Teaching Methods Techniques | Ön Hazırlık / Preliminary |
|              | Bankacılıkta risk yönetimi, BIS ve BASEL                                         |          |     |                                                          |                           |
|              | Risk management in banking, BIS and BASEL                                        |          |     |                                                          |                           |
| 4            | Teorik Dersler / Theoretical                                                     | Uygulama | Lab | Öğretim Yöntem ve Teknikleri/Teaching Methods Techniques | Ön Hazırlık / Preliminary |
|              | Risk yönetim teknikleri içerisinde Türev Ürünler                                 |          |     |                                                          |                           |
|              | Derivatives within risk management techniques                                    |          |     |                                                          |                           |
| 5            | Teorik Dersler / Theoretical                                                     | Uygulama | Lab | Öğretim Yöntem ve Teknikleri/Teaching Methods Techniques | Ön Hazırlık / Preliminary |
|              | Forward Sözleşmeler                                                              |          |     |                                                          |                           |
|              | Forward Contracts                                                                |          |     |                                                          |                           |

|    |                                                |          |     |                                                          |                           |
|----|------------------------------------------------|----------|-----|----------------------------------------------------------|---------------------------|
| 6  | Teorik Dersler / Theoretical                   | Uygulama | Lab | Öğretim Yöntem ve Teknikleri/Teaching Methods Techniques | Ön Hazırlık / Preliminary |
|    | Future Sözleşmeler                             |          |     |                                                          |                           |
|    | Future Contracts                               |          |     |                                                          |                           |
| 7  | Teorik Dersler / Theoretical                   | Uygulama | Lab | Öğretim Yöntem ve Teknikleri/Teaching Methods Techniques | Ön Hazırlık / Preliminary |
|    | Opsiyonlar ve Swaplar                          |          |     |                                                          |                           |
|    | Options and Swaps                              |          |     |                                                          |                           |
| 8  | Teorik Dersler / Theoretical                   | Uygulama | Lab | Öğretim Yöntem ve Teknikleri/Teaching Methods Techniques | Ön Hazırlık / Preliminary |
|    | Ara Sınav                                      |          |     |                                                          |                           |
|    | Midterm                                        |          |     |                                                          |                           |
| 9  | Teorik Dersler / Theoretical                   | Uygulama | Lab | Öğretim Yöntem ve Teknikleri/Teaching Methods Techniques | Ön Hazırlık / Preliminary |
|    | Finansal Tablo Analizi                         |          |     |                                                          |                           |
|    | Financial Statement Analysis                   |          |     |                                                          |                           |
| 10 | Teorik Dersler / Theoretical                   | Uygulama | Lab | Öğretim Yöntem ve Teknikleri/Teaching Methods Techniques | Ön Hazırlık / Preliminary |
|    | Bilanço                                        |          |     |                                                          |                           |
|    | balance-sheet                                  |          |     |                                                          |                           |
| 11 | Teorik Dersler / Theoretical                   | Uygulama | Lab | Öğretim Yöntem ve Teknikleri/Teaching Methods Techniques | Ön Hazırlık / Preliminary |
|    | Bilanço ve Gelir Tablosu etkileşimi            |          |     |                                                          |                           |
|    | Balance Sheet and Income Statement interaction |          |     |                                                          |                           |

|    |                                                                   |          |     |                                                          |                           |
|----|-------------------------------------------------------------------|----------|-----|----------------------------------------------------------|---------------------------|
| 12 | Teorik Dersler / Theoretical                                      | Uygulama | Lab | Öğretim Yöntem ve Teknikleri/Teaching Methods Techniques | Ön Hazırlık / Preliminary |
|    | Mali Analiz Teknikleri                                            |          |     |                                                          |                           |
|    | Financial Analysis Techniques                                     |          |     |                                                          |                           |
| 13 | Teorik Dersler / Theoretical                                      | Uygulama | Lab | Öğretim Yöntem ve Teknikleri/Teaching Methods Techniques | Ön Hazırlık / Preliminary |
|    | Karşılaştırmalı Mali Tablolar ve Dikey Yüzde Analizi              |          |     |                                                          |                           |
|    | Comparative Financial Statements and Vertical Percentage Analysis |          |     |                                                          |                           |
| 14 | Teorik Dersler / Theoretical                                      | Uygulama | Lab | Öğretim Yöntem ve Teknikleri/Teaching Methods Techniques | Ön Hazırlık / Preliminary |
|    | Eğilim Yüzdeleri Analizi                                          |          |     |                                                          |                           |
|    | Trend Percentage Analysis                                         |          |     |                                                          |                           |
| 15 | Teorik Dersler / Theoretical                                      | Uygulama | Lab | Öğretim Yöntem ve Teknikleri/Teaching Methods Techniques | Ön Hazırlık / Preliminary |
|    | Final Sınavı                                                      |          |     |                                                          |                           |
|    | final examination                                                 |          |     |                                                          |                           |

## 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                                             | 1             | 1.00                             | 1.00                                           |
| Bütünleme Sınavı / Makeup Examination                                       | 1             | 1.00                             | 1.00                                           |
| Derse Katılım / Attending Lectures                                          | 14            | 3.00                             | 42.00                                          |
| Final Sınavı / Final Examination                                            | 1             | 1.00                             | 1.00                                           |
| Bireysel Çalışma / Self Study                                               | 14            | 3.00                             | 42.00                                          |
| Final Sınavı için Bireysel Çalışma / Individual Study for Final Examination | 1             | 20.00                            | 20.00                                          |
| Ara Sınav için Bireysel Çalışma / Individual Study for Mid term Examination | 1             | 20.00                            | 20.00                                          |
| Toplam / Total:                                                             | 33            | 49.00                            | 127.00                                         |

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.Risk konsepti, analiz yöntemleri, ve risk enformasyonu kullanımı genel olarak anlama yetisi kazanır. / Gain a general understanding of the concept of risk, analysis methods, and the use of risk information.                   |                                      |       |       |       |       |       |       |       | 4     |        |
| 2.Finansal piyasalardan ve finansal kurumlardan edinilen bilgileri tanımlama ve yorumlama becerisi kazanır / Gains the ability to define and interpret the information obtained from financial markets and financial institutions. |                                      |       |       |       |       |       |       |       | 4     |        |
| 3.Finansal varlık ve portföy risklerini kavrar, yorumlar ve hesaplar. / Understands, interprets and calculates financial asset and portfolio risks.                                                                                |                                      |       |       |       |       |       |       | 4     |       |        |
| 4.Finansal risk analizinde kullanılan modern teknikleri gerçek hayat finansal problemlerine uygular. / Applies modern techniques used in financial risk analysis to real life financial problems.                                  |                                      |       |       |       |       |       |       | 4     | 4     |        |

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