GENEL TANIM / GENERAL DESCRIPTION

Ders Adı / Course Name	Financial Risk Analysis / Financial Risk Analysis	
Ders Kodu / Course Code	EBNF322	
Ders Türü / Course Type		
Ders Seviyesi / Course Level	Bachelor / Bachelor	
Ders Akts Kredi / ECTS	6.00	
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 Bankacılık sektörü risklerinin incelenmesi Finansal tablo analizi ile risklerin tanınması Finansal riskten korunma için kullanılabilecek finansal marketlerin ve enstrümanların tanınması Gerçek piyasa işlemleri ile örneklendirme metotları ile öğrenme	Identifying risks in financial markets Examination of banking sector risks Recognition of risks with financial statement analysis Recognition of financial markets and instruments that can be used for financial risk hedging 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 SEVGEN	

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					
	Teorik Dersler / Theoretical	Uygulama	Lab	Öğretim Yöntem ve Teknikleri/Teaching Methods Techniques	Ön Hazırlık / Preliminary
1	Finansal Risk Analizi kavramına ve dersin içeriğine genel bakış				
	Overview of the concept of Financial Risk Analysis and the content of the course				
	Teorik Dersler / Theoretical	Uygulama	Lab	Öğretim Yöntem ve Teknikleri/Teaching Methods Techniques	Ön Hazırlık / Preliminary
2	Risklerin ölçülmesi, sınıflandırılması ve risk yönetimi uygulamaları				
	Measuring, classifying risks and risk management practices				
	Teorik Dersler / Theoretical	Uygulama	Lab	Öğretim Yöntem ve Teknikleri/Teaching Methods Techniques	Ön Hazırlık / Preliminary
3	Bankacılıkta risk yönetimi, BIS ve BASEL				
	Risk management in banking, BIS and BASEL				
	Teorik Dersler / Theoretical	Uygulama	Lab	Öğretim Yöntem ve Teknikleri/Teaching Methods Techniques	Ön Hazırlık / Preliminary
4	Risk yönetim teknikleri içerisinde Türev Ürünler				
	Derivatives within risk management techniques				
	Teorik Dersler / Theoretical	Uygulama	Lab	Öğretim Yöntem ve Teknikleri/Teaching Methods Techniques	Ön Hazırlık / Preliminary
5	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 Yükü (Saat) / Total Work Load (Hour)
Ara Sınav / Midterm Examination	1	1.00	1.00
Bütünleme Sınavı / Makeup Examination	10	1.00	10.00
Derse Katılım / Attending Lectures	15	3.00	45.00
Final Sınavı / Final Examination	1	1.00	1.00
Bireysel Çalışma / Self Study	14	3.00	42.00
Final Sınavı içiin Bireysel Çalışma / Individual Study for Final Examination	1	20.00	20.00
Ara Sınav İçin Bireysel Çalışma / Individual Study for Mid term Examination	1	20.00	20.00
Toplam / Total:	43	49.00	139.00

Dersin AKTS Kredisi = Toplam İş Yükü (Saat) / 25.00 (Saat/AKTS) = 139.00/25.00 = 5.56 ~ / Course ECTS Credit = Total Workload (Hour) / 25.00 (Hour / ECTS) = 139.00 / 25.00 = 5.56 ~

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 kullanımını genel olarak anlama yetisi kazanır. / Gain a general understanding of the concept of risk, analysis methods, and the use of risk information.	4	3	4	5	4	3	4	4	2	5
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	4	4	4	3	3	2	4	2	4
3.Finansal varlık ve portföy risklerini kavrar, yorumlar ve hesaplar. / Understands, interprets and calculates financial asset and portfolio risks.	4	4	4	2	3	4	3	5	3	3
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	3	3	3	3	3	3	3	4

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