İSTANBUL KÜLTÜR ÜNİVERSİTESİ
SBE, İKTİSAT ANABİLİM DALI
İktisat - Yönetim Ekonomisi Yüksek Lisans Programı
2004-2005 Güz Yarıyılı

Ders: RİSK YÖNETİMİ VE ORGANİZASYONU
Eğitmen: Dr. K.Evren BOLGÜN-

İçerik: Son yıllarda yıldızı parlayan bir konu olan RiskYönetiminin önümüzdeki yıllarda da yükselen bir trend izlemesi beklenmektedir. Özellikle Piyasa ve Kredi Risk Ölçüm ve Yönetimi konusunda teorik ve uygulamalı çeşitli örnekler irdelenecektir. Dersin temel amacı, uluslararası alanda genel kabul görmüş tüm risk yönetimi modelleri teorilerine ve uygulamasına hakim, Türkiye'ye özgü sorunlara çözüm üretebilecek, Basel-II Prensiplerini özümsemiş, Kurumsal Risk Yöneticileri ve Uzmanları yetiştirmektir.

Temel Kaynak

1. Ders Notları
2. Bolgün K.Evren, Akçay Barış.(2003), Risk Yönetimi, Scala Yayıncılık
3. Çeşitli Gauss, Eviews, Excel Spreadsheets, Crystall Ball Uygulamaları.

Yardımcı Kaynaklar

4. www.tcmb.gov.tr, www.bddk.org.tr, www.spk.gov.tr, www.treasury.gov.tr

Değerleme Metodu:

Quiz, Vize Sınavı	% 40
Final Sınavı	% 60
Ders Katılımı	%100

DERS İÇERİĞİ

1.Hafta
Risk Yönetimine Duyulan İhtiyaç & Finansal Skandallar
Baring's Bank,LTCM,Enron,Demirbank,İmarBank

2.Hafta
Uluslararası Finansal Piyasalardaki Yasal Düzenlemeler_BASEL II
Basel I ve Basel II Temel Prensipleri, Basel II Türkiye Yol Haritası-BDDK

3.Hafta
Finansal Risk ve Belirsizlik Teorisi
Fayda Teorisi, Risk Algılama
Psikoloji,Risk ve Yatırım, Kahneman Daniel-Princeton Üniversitesi

4.Hafta
Finansal Ürünler ve Fiyatlaması I-II
Vade Yapısı Teorisi,Faiz-Risk İlişkisi
Sabit,Değişken Getirili ve Finansal Türev Enstrümanlar

5.Hafta
Risk Yönetiminde Temel İstatistik ve Ekonometri Teknikleri
Tanımlayıcı İstatistikler, Finansal Tahmin Yöntemleri
Portföy Teorisi

© K.Evren BOLGÜN, Güz 2004

6.Hafta
Riske Maruz Değer Nedir? (VaR)
Tarihsel Benzetim, Varyans Kovaryans, Monte Carlo Yöntemi
Uygulamalı Piyasa Risk Ölçümü

7.Hafta
Kredi Risk Yönetimi
Basel II çerçevesinde Kredi Risk Ölçüm Metodolojisi
Hipotetik Portföy Üzerinden Kredi Risk Ölçümü

8.Hafta
Türkiye'de Risk Yönetimi Sorunları ve Risk Yönetim Organizasyonu
Yasal Düzenlemelerin Uluslararası Piyasalara Uyumu
Kurum içi Entegre Risk Yönetim Yapısı ve Organizasyonu

© K.Evren BOLGÜN, Güz 2004