T.C. KADİR HAS ÜNİVERSİTESİ
Sosyal Bilimler Enstitüsü, Finans Bankacılık Y.Lisans
2003-2004 Güz Dönemi

Ders:- RİSK YÖNETİMİ
Çarşamba 20.20-22.00
Eğitmen: Dr. K.Evren BOLGÜN

Amaç: 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, R*isk Yöneticileri* ve U*zmanları* yetiştirmektir.

Kaynaklar:

- Bolgün K.Evren, Akçay M.Barış; (2003) Risk Yönetimi, Scala Yayıncılık.
- Çeşitli Gauss, Eviews, Excel Spreadsheets, Crystall Ball Uygulamaları.

Değerleme: %30 Dönem Ödevi
%30 Vize
%40 Final

Ders İçeriği

1.Hafta	Risk Yönetimine Duyulan İhtiyaç & Finansal Skandallar
2.Hafta	Uluslararası Finansal Piyasalardaki Yasal Düzenlemeler_BASEL II
3.Hafta	Finansal Risk ve Belirsizlik Teorisi
4.Hafta	Finansal Ürünler ve Fiyatlaması
5.Hafta	Vize Sınavı
6.Hafta	Risk Yönetiminde Temel İstatistik ve Ekonometri Teknikleri
7.Hafta	Vade Yapısı ve Verim Eğrisi Modellemesi
8.Hafta	Riske Maruz Değer Nedir? (VaR)
9.Hafta	Riske Maruz Değer Ölçüm Modelleri
10.Hafta	İleri Finansal Modelleme Teknikleri
11.Hafta	Kredi Risk Yönetimi
12.Hafta	Operasyonel Risk Yönetimi
13.Hafta	Risk Yönetiminin Stratejik Açıdan Kullanımı_RAROC
14.Hafta	Türkiye'de Risk Yönetiminin Yapısal Sorunları