Ders İzlencesi

Ders Kodu - Ders Adı	**İKT584 - Bankacılıkta Risk Yönetimi ve Sermaye Yeterliliği**
Ders Türü	II.Yarıyıl
Teori + Uygulama	3+0
AKTS	**6.0**
Ders Dili	Türkçe
Ders Türü	Seçmeli Dersler
Öğretim Elemanları	PROF. DR. HASAN MURAT ERTUĞRUL

Dersin Veriliş Biçimi	Uzaktan öğretim teknikleri
Önkoşullar	Hiç
Önerilen Dersler	Hiç
Önerilen Kaynaklar	• Banka İktisadı ve İşletmeciliği, Editörler: N.O. Altay, C.C.Küçüközmen; M. Ural, E. Demireli, Detay Yayıncılık 2014 • Para İktisadı Teori ve Politika, Editör: N. O. Altay, Palme Yayıncılık, 2014.• Risk Yönetimi, K.E. Bolgün, B. Akçay, SCALA Yayıncılık, 2009
Staj & Uygulama	Hiç

Ders İzlencesi

Haftalar	Öğrenme Çıktıları	Konular	Öğretim Yöntemleri
1. hafta		Küresel Finansal Kriz	
2. hafta		Finansal Risk Yönetimi	
3. hafta		Piyasa Riski	
4. hafta		Kredi Riski	
5. hafta		Operasyonel Risk & Likidite Riski	
6. hafta		Veri: Toplama, Sınıflama, Analiz ve Görselleştirme	
7. hafta		Duyarlılık Analizi	
8. hafta		Volatilite ve Volatilite Tahmini	
9. hafta		Banka Sermayesi ve Basel Düzenlemeleri	
10. hafta		Basel-I'den Günümüz Basel Düzenlemelerine Geçiş (Uygulamalı)	
11. hafta		Riske Maruz Değer ve Sermaye Yeterliliğinin Hesaplanması	
12. hafta		Stres Testleri	
13. hafta		Senaryo Analizi	
14. hafta		Risk Yönetiminde Vaka Analizleri	

Öğrenme Çıktıları

#	Öğrenme Çıktıları
1	Finansal riskleri tanıyarak bunların uygun modellerle ölçülmesini ve tahmin edilmesi çerçevesinde analizler yaparak öngörülerde bulunabilecek

Öğrenme Çıktıları

#	Öğrenme Çıktıları
2	Finansal risklerin hesaplamasında kullanılacak istatistiksel ve ekonometrik yöntemleri kavrayarak bunları yazılım eşliğinde kullanabilecek, elde edilecek sonuçları yorumlayabilecek
3	Veri analizi ve veri görselleştirme teknikleri yardımıyla karmaşık ilişkileri grafiklerle kolayca ifade edebilecek
4	Bir bankanın bilançosunu, alım satım ve kredi portföyünü tanımlayarak modelleme yoluyla analiz edebilecek, risk içeren yönlerini tespit ederek alınması gereken gerekli önlemleri önerebilecek

Sürdürülebilir Kalkınma Amaçları

İçerik girilmemiştir.

Dersin Teması

İçerik girilmemiştir.

AKTS İş Yükü

Etkinlik	Süre (Saat)	Sayı	İş Yükü
Teorik Derse Katılım	0	0	0
Sınıf Dışı Çalışma (Ön Hazırlık & Pekiştirme Amaçlı)	0	0	0
Ödevler	0	0	0
Proje - Rapor - Sunum Hazırlama	0	0	0
Ara Sınav Hazırlığı (sınav süresi dahil)	0	0	0
Final Sınavı Hazırlığı (sınav süresi dahil)	0	0	0
Uygulama (Laboratuvar, Müzik/Enstrüman Uygulaması, Atölye/Saha Çalışması vb.)	0	0	0
Staj Uygulaması	0	0	0
		Hesaplanan AKTS	**0**

Ölçme ve Değerlendirme

İçerik girilmemiştir.