



Risk Yönetimi (LOJ 414) Ders Detayları

| Ders Adı | Ders Kodu | Dönemi | Ders Saati | Uygulama Saati | Laboratuar Saati | Kredi | AKTS |
|---------------|-----------|---------|------------|----------------|------------------|-------|------|
| Risk Yönetimi | LOJ 414 | Her İki | 3 | 0 | 0 | 3 | 6 |

| | |
|---------------------|--|
| Ön Koşul Ders(ler)i | |
|---------------------|--|

| | |
|--------------------------------------|---------------------------------------|
| Dersin Dili | İngilizce |
| Dersin Türü | Teknik Seçmeli Dersler |
| Dersin Seviyesi | Lisans |
| Ders Verilme Şekli | Yüz Yüze |
| Dersin Öğrenme ve Öğretme Teknikleri | Anlatım, Tartışma, Soru-Yanıt |
| Dersin Koordinatörü | |
| Dersin Öğretmen(ler)i | • Yrd. Doç. Dr. Neslihan Turguttopbaş |

| | |
|--------------------------------|--|
| Dersin Asistanı | |
| Dersin Amacı | Uluslararası ticaret kapsamında oluşan rekabetçi koşullar ve piyasanın yarattığı kur, faiz ve kredi riskinin tanımlanması, ölçülmesi ve yönetilmesi hususlarında gereken bilgilendirmenin sağlanması dersin amacıdır. |
| Dersin Eğitim Çıktıları | <p>Bu dersi başarıyla tamamlayabilen öğrenciler;</p> <ul style="list-style-type: none"> • Temel finansal riskleri tanımları ve etkileri kapsamında bilir. • Faiz oranlarının vade perspektifi kapsamında oluşumunu belirleyen faktörleri açıklayabilir. • Döviz kurlarını belirleyen faktörleri tanımlayabilir. • Emtia fiyatlarının ne şekilde belirlendiğini açıklayabilir. • Kredi riskinin bileşenleri ve ne şekilde yönetilebileceği hakkında bilgi sahibidir. |
| Dersin İçeriği | Uluslararası ticaret ve yerel işlemler sonucunda maruz kalınan faiz, kur, kredi riski gibi riskler açıklanacak, söz konusu riskleri oluşturan faktörler ve risklilik ölçüm yöntemleri öğretilecektir. |

Haftalık Konular ve İlgili Ön Hazırlık Çalışmaları

| Hafta | Konular | Ön Hazırlık |
|-------|---|--|
| 1 | Risk kavramı ve riskin kaynakları ve oluşum sebepleri, finansal risk yönetimine giriş | Essentials of Financial Risk Management, Horcher, Karen A. Bölüm 1 |
| 2 | Faiz oranları ve döviz kurlarını belirleyen faktörler | Essentials of Financial Risk Management, Horcher, Karen A. Bölüm 1 |
| 3 | Temel finansal risklerin belirlenmesi | Essentials of Financial Risk Management, Horcher, Karen A. Bölüm 2 |

| | | |
|----|--|--|
| 4 | Faiz Riski ve bileşenleri | Essentials of Financial Risk Management, Horcher, Karen A. Bölüm 3 |
| 5 | Kur riski ve bileşenleri | Essentials of Financial Risk Management, Horcher, Karen A. Bölüm 3 |
| 6 | Kur riski ve uluslararası ticarete kur riskinin etkisi | Essentials of Financial Risk Management, Horcher, Karen A. Bölüm 4 |
| 7 | Kur riskinden korunma yöntemleri | Essentials of Financial Risk Management, Horcher, Karen A. Bölüm 4 |
| 8 | Ara sınav | |
| 9 | Kredi riskinin bileşenleri | Essentials of Financial Risk Management, Horcher, Karen A. Bölüm 5 |
| 10 | Kredi riski yönetimi ilke ve yöntemleri | Essentials of Financial Risk Management, Horcher, Karen A. Bölüm 5 |
| 11 | Emtia fiyatlarına ilişkin riskler ve üretim maliyetlerine etkisi | Essentials of Financial Risk Management, Horcher, Karen A. Bölüm 6 |
| 12 | Emtia fiyat riskinden korunma yöntemleri | Essentials of Financial Risk Management, Horcher, Karen A. Bölüm 6 |
| 13 | Operasyonel riski oluşturan faktörler | Essentials of Financial Risk Management, Horcher, Karen A. Bölüm 7 |
| 14 | Operasyonel risk yönetim teknikleri | Essentials of Financial Risk Management, Horcher, Karen A. Bölüm 7 |
| 15 | Genel Tekrar ve Saha Uygulamalı Soru Çözümü | |
| 16 | Genel Sınav | |

Kaynaklar

Ders Kitabı: 1. Essentials of Financial Risk Management, Karen A. Horcher, Wiley, 2005.

Değerlendirme Sistemi

| Çalışmalar | Sayı | Katkı Payı |
|-------------------------------|----------|------------|
| Devam/Katılım | 1 | 10 |
| Laboratuar | - | - |
| Uygulama | - | - |
| Alan Çalışması | - | - |
| Derse Özgü Staj | - | - |
| Küçük Sınavlar/Stüdyo Kritiği | - | - |
| Ödevler | 1 | 10 |
| Sunum | - | - |
| Projeler | - | - |
| Seminer | - | - |
| Ara Sınavlar/Ara Juri | 1 | 30 |
| Genel Sınav/Final Juri | 1 | 50 |
| Toplam | 4 | 100 |

**Yarıyıl İçi Çalışmalarının Başarı Notu
Katkısı**

50

| | |
|--|-----|
| Yarıyıl Sonu Çalışmalarının Başarı Notuna Katkısı | 50 |
| Toplam | 100 |

Ders Kategorisi

| | |
|--|---|
| Temel Meslek Dersleri | |
| Uzmanlık/Alan Dersleri | X |
| Destek Dersleri | |
| İletişim ve Yönetim Becerileri Dersleri | |
| Aktarılabılır Beceri Dersleri | |

Dersin Öğrenim Çıktılarının Program Yeterlilikleri ile İlişkisi

| # | Program Yeterlilikleri / Çıktıları | Katkı Düzeyi | | | | |
|---|---|--------------|---|---|---|---|
| | | 1 | 2 | 3 | 4 | 5 |
| 1 | Küreselleşen iş dünyasındaki gelişmelerin izinde uluslararası ticaret ve lojistik alanlarında edinilen kuramsal ve uygulamalı bilgileri disiplinlerarası bir yaklaşımla uzmanlık geliştirecek biçimde kullanabilmek | | | | X | |

| | | | | | |
|----|--|--|--|---|---|
| 2 | Uluslararası ticaret ve lojistik alanlarındaki donanımını reel süreçlere aktif biçimde kanalize ederek yönetme becerisini ortaya koymak | | | X | |
| 3 | Bağlı olduğu birimdeki çalışanlarla yazılı ve sözlü olarak verimli iletişim kurabilmek ve mesleki gelişim etkinliklerini organize edebilmek | | | X | |
| 4 | Esnek ve gelişmeye açık uluslararası ticaret ve lojistik alanlarındaki dinamikleri, temel ve güncel kuramsal çerçeve içerisine oturtarak değerlendirmek | | | | X |
| 5 | Uluslararası ticaret ve lojistik alanlarındaki karmaşık sorunları çökyönlülüğü kucaklayan bir biçimde analitik ve bağımsız düşünme yetisi ve sentez kabiliyetiyle çözüme kavuşturmak | | | | X |
| 6 | Sektörel değişimleri ve yenilikleri takip ederek mesleki yetkinliğini geliştirip donanımını güncel tutmak | | | | X |
| 7 | Eğitimi boyunca edindiği bilgileri mevcut ekonomik konjonktür dahilinde yorumlama, sorgulama ve derinleştirme yeteneğine sahip olmak | | | | X |
| 8 | Uluslararası ticaret ve lojistik uygulamalarında sektörel koordinasyon sağlayarak mevcut ve muhtemel sorunlara yenilikçi bir yaklaşımla esnek, etkin ve hızlı çözüm üretmek için sorumluluk almak ve organizasyon becerisine sahip olmak | | | | X |
| 9 | Ulusal ve uluslararası platformda özel sektörün şiddetle gereksinim duyduğu güncel teknik donanıma ve çoklu dil becerisine sahip olmanın yanısıra alana özgü yaygın bilişim ve yazılım programlarına hâkim olmak | | | X | |
| 10 | Eğitim aldığı alanın uluslararası niteliğine paralel olarak her platformda etkin iletişim kurabilecek düzeyde İngilizce bilgisine sahip olmak | | | X | |
| 11 | Sosyal ve entelektüel kapasitesi gelişmiş, vizyon sahibi ve etik değerleri yüksek , grup iletişimine uyum becerisi gösteren bireyler olmak, | | | X | |

ECTS/İş Yüğü Tablosu

| Aktiviteler | Sayı | Süresi (Saat) | Toplam İş Yüğü |
|---|------|---------------|----------------|
| Ders saati (Sınav haftası dahildir: 16 x toplam ders saati) | 16 | 3 | 48 |
| Laboratuar | | | |
| Uygulama | | | |
| Derse Özgü Staj | | | |
| Alan Çalışması | | | |
| Sınıf Dışı Ders Çalışma Süresi | 14 | 3 | 42 |
| Sunum/Seminer Hazırlama | | | |
| Projeler | | | |
| Ödevler | 1 | 10 | 10 |
| Küçük Sınavlar/Stüdyo Kritiğı | | | |
| Ara Sınavlara/Ara Juriye Hazırlanma Süresi | 1 | 35 | 35 |
| Genel Sınav/Genel Juriye Hazırlanma Süresi | 1 | 45 | 45 |
| Toplam İş Yüğü | | | 180 |