

Dersin Kodu: FE 544				Dersin Adı: Sabit Getirili Menkul Kıymet Piyasaları			
Yarıyılı	D + U + L	Kredisi	AKTS	Dersin Dili	Dersin Türü	İşleniş Yöntemi	Ön Koşulları
1	3+0+0	3	8	İngilizce	Zorunlu		-
Dersin Amacı				Bu dersin amacı, sabit getirili menkul kıymetler ve bono portföy yönetimi için kantitatif bir yaklaşım sağlamaktır.			
Dersin İçeriği				Bu ders, bono ve sabit getirili türev ürünlerin fiyatlandırılması, faiz oranı riskinin ölçümü ve riskten korunmayı, dinamik faiz oranı modelleri ve sabit getirili portföy riskinin yönetimi konularını kapsamaktadır			
Dersin Öğrenme Çıktıları				<ol style="list-style-type: none"> 1. bono ve sabit getirili türev ürünlerin fiyatlandırılması, 2. faiz oranı riskinin ölçümü 3. riskten korunma, 4. dinamik faiz oranı modelleri ve sabit getirili portföy riskinin yönetimi için kantitatif modeller oluşturmak. 			
Dersin ISCED Kategorisi				46-Matematik ve İstatistik (%50), 52-Mühendislik (%50)			
Ders Kitabı				K.Nyholm, (2008). Strategic Asset Allocation in Fixed Income Markets: A MatLab Based User Guide, Wiley.			
Yardımcı Kaynaklar				-			

HAFTALIK KONULAR

Hafta	Teorik Ders Konuları	Uygulama / Laboratuvar Konuları
1	Kavramsal Olarak Sabit Getirili Menkul Kıymetler	
2	Sabit Getirili Menkul Kıymetlerin Ortaya Çıkışı, Fiyatlaması ve Satışı	
3	Sabit Getirili Menkul Kıymetler Piyasası	
4	Sabit Getirili Menkul Kıymetler Piyasası	
5	Bono ve Sabit Getirili Türev Ürünlerin Fiyatlandırılması	
6	Bono ve Sabit Getirili Türev Ürünlerin Fiyatlandırılması	
7	Ara Sınav	
8	Faiz Oranı Riskinin Ölçümü	
9	Riskten Korunma	
10	Dinamik Faiz Oranı Modelleri	
11	Sabit Getirili Portföy Yönetimi	
12	Kantitatif Modeller ve Uygulamaları	
13	Kantitatif Modeller ve Uygulamaları	
14	Final Sınavı	

DERSİN DEĞERLENDİRME SİSTEMİ

	Etkinlikler	Adet	Katkı Oranı (%)
Yarıyıl İçi Çalışmaları	Kısa Sınavlar	3	35
	Dönem Ödevi / Projesi	0	0
	Raporlar	0	0
	Bitirme Tezi/Projesi	0	0
	Seminer	0	0
	Ödevler	4	40
	Sunum	0	0
	Arasınavlar	0	0
	Proje	0	0
	Laboratuvar	0	0
	Diğer	0	0
YARIYIL SONU SINAVI		1	25
Toplam		6	100

DERSİN FİNANS MÜHENDİSLİĞİ PROGRAMI KAZANIMLARINA (ÇIKTILARINA) KATKISI

	Program Kazanımları (Çıktıları)	1	2	3
1	Öğrencilerin uluslararası finansal piyasalarda yaşanan gelişmeler ve yenilikler hakkında bilgilendirilmesini sağlamak		*	
2	Türkiye'nin finansal ürün çeşitliliği ve hizmetler konusunda dünyanın en önemli merkezlerinden biri haline dönüşmesini sağlamak ve bu alanda uzman işgücünü yetiştirmek.			
3	Yeni finansal ürünleri tasarlama, üretme ve pazarlama konusunda uzmanlık kazandırmak.		*	
4	Finansal piyasaları değerlendirmede, yatırım stratejilerini belirlemede, sigortacılık, yatırım fonları gibi farklı alanlarda risk analizleri yapmada kullanılan araç ve teknikleri öğretmek.		*	
5	Finansal problemler karşısında matematiksel modeller kurabilen ve bunları hesaplama yöntemleri ile çözebilen uzmanlar eğitmek			*
6	Disiplinler arası çalışma ve araştırma gruplarında liderlik yapmak ve sorumluluk almak; karmaşık durumlarda stratejik çözüm yaklaşımları geliştirebilmek.			
7	En az 1 yabancı dili mesleki ve akademik yaşamda etkin biçimde kullanmak.			
8	Mesleki ve etik sorumluluk bilinci kazanmak.			

Katkı Derecesi: 1 düşük, 2 orta, 3 yüksek

AKTS - İŞ YÜKÜ TABLOSU

ETKİNLİKLER	Sayı	Süre (Saat)	İş Yüğü
Ders Süresi	14	3	42
Yarıyıl Sonu Sınavı (Hazırlık Süresi Dahil)	1	30	30
Kısa Sınavlar	0	0	0
Dönem Ödevi / Projesi	0	0	0
Raporlar	0	0	0
Bitirme Tezi/Projesi	0	0	0
Seminer	0	0	0
Sınıf Dışı Çalışma Süresi	14	2	28
Ödevler	4	20	80
Sunum	0	0	0
Arasınavlar (Hazırlık Süresi Dahil)	1	20	20
Proje	0	0	0
Laboratuvar	0	0	0
Toplam İş Yüğü			200
Dersin AKTS Kredisi (Toplam İş Yüğü / 25)			8

Revizyon/Tarih 20.12.2013	Koordinatör / HAZIRLAYAN	ONAYLAYAN
------------------------------	--------------------------	-----------