

DERS TANITIM ve UYGULAMA BİLGİLERİ

Dersin Adı	Kodu	Yarıyıl	T+U+L (saat/hafta)	Türü (Z / S)	Yerel Kredi	AKTS
Finans Matematiği II	FE 502	Bahar	03+00+00	Zorunlu	3	7.5
Akademik Birim:						
Öğrenim Türü:		Örgün eğitim				
Ön Koşullar		Yok				
Öğrenim Dili:		İngilizce				
Dersin Düzeyi:		Yüksek Lisans				
Dersin Koordinatörü:		Ayşe Hümeysra BİLGE				
Dersin Amacı:		Finans mühendisliğinin olasılık, istatistik ve stokastik süreçleri içeren alanlarında temel bilgilerin verilmesi				
Dersin İçeriği:		Olasılık ve istatistikte temel kavramlar. Riske maruz değer hesapları. Stokastik süreçler. Black-Scholes modeli. Opsiyon fiyatlama, "greeks". Finansal zaman serileri ARMA ve GARCH modelleri				
Dersin Öğrenme Çıktıları (ÖÇ):						
Dersin Öğrenme Yöntem ve Teknikleri		Teorik ve uygulamalı				

HAFTALIK PROGRAM

Hafta	Konular	Ön Hazırlık
-------	---------	-------------

Kadir Has Üniversitesi'nde bir dönem 14 haftadır, 15. ve 16. hafta sınav haftalarıdır.

ZORUNLU ve ÖNERİLEN OKUMALAR

Options, Futures and Other Derivatives, J. Hull, Pearson 2009

DİĞER KAYNAKLAR

Yok

DEĞERLENDİRME SİSTEMİ

Yarıyıl İçi Çalışmaları	Sayı	Katkı Payı (%)
Total:	0	0

İŞ YÜKÜ HESAPLAMASI

Etkinlikler	Sayısı	Süresi (saat)	Toplam İş Yüğü (saat)
Toplam İş Yüğü (saat):			0

1 AKTS = 25 saatlik iş yüğü

PROGRAM YETERLİLİKLERİ (PY) ve ÖĞRENME ÇIKTILARI (ÖÇ) İLİŞKİSİ

#	PY1	PY2	PY3	PY4	PY5	PY6	PY7	PY8	PY9	PY10
---	-----	-----	-----	-----	-----	-----	-----	-----	-----	------

Katkı Düzeyi: 1 Düşük, 2 Orta, 3 Yüksek