

# 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	Güz	03+00+00	Seçmeli	3	7.5
Akademik Birim:						
Öğrenim Türü:	Örgün eğitim					
Ön Koşullar	Yok					
Öğrenim Dili:	İngilizce					
Dersin Düzeyi:	Yüksek Lisans					
Dersin Koordinatörü:	Ayşe Hümevra 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
---	-----	-----	-----	-----	-----	-----	-----	-----	-----

**Katkı Düzeyi:** 1 Düşük, 2 Orta, 3 Yüksek