

## AMAÇ

Hazine biriminin yapısını ve diğer birimler ile ilişkilerini, hazine işlemlerinin fiyatlandırma tekniklerini ve risk analizlerini uygulamalı şekilde aktarmak amaçlanmaktadır.

## ODAK NOKTALARI

#Mevzuat #Fiyatlama #Hazine Ürünleri #Karlılık #Sözleşmeler #Kredi Limitleri #Teminatlandırma #Data Sağlayıcılar #Türev İşlemler #Düzenleyici Kurumlar #Piyasa Yapıcılığı #Risk Yönetimi

## EĞİTİMDEN BEKLENEN SONUÇLAR

**Bilir:**Banka hazinelerinin faaliyet gösterdiği piyasaları, bankaların ilişkide olduğu yasal düzenleyici otoriteleri ve yabancı data sağlayıcıları bilir.

**Anlar:**Banka hazinelerinin birbirleri ile ve müşteriler ile ilişkilerinin nasıl yürütüldüğünü anlar. Banka hazinelerinin düzenleyici kurumlar ile ilişkilerini anlar. Türev işlemlerin nasıl fiyatlandığını anlar. Finansal risklerin nasıl yönetildiğini ve hazine enstrümanlarının nasıl fiyatlandığını anlar. Piyasa işleyişini ve hazine dilini anlar. Hazinelerin krediler, hukuk ve risk yönetimi birimleri ile ilişkilerini anlar. Hazinelerin ve hazine işlemlerinin nasıl denetleneceğini anlar.

**Yapar:**Hazine enstrümanlarını fiyatlar ve müşteriler ile gerekli iletişimi kurabilir. Müşterilere hazine işlemlerinin fiyatlandırılmasında yetkinlik kazanır. Yabancı data sağlayıcıları ve fiyatlayıcıları etkin kullanır. Piyasalardaki hareketleri etkin bir şekilde yorumlayabilir.

## HEDEF KİTLE

Hazine, hazine operasyon, teminat yönetimi, risk yönetimi, teftiş, iç kontrol bölümü çalışanları ile konuyu derinlemesine öğrenmek isteyen tüm çalışanların katılımına uygundur.

## NOT

## İÇERİK

- ❑ Bankalarda Hazine Organizasyonu
  - ▶ Hazine Front Office
  - ▶ Hazine Middle Office
  - ▶ Hazine Back Office
  - ▶ Aktif Pasif Yönetimi Birimi
  - ▶ Teminat Takip Birimi
  - ▶ Bu Birimler Birbirleri ile Nasıl Etkileşir?
  - ▶ Bu Birimlerin Bankanın İç ve Dış Müşterileri ile İlişkileri Nasıl Yönetilir?
- ❑ Piyasalar
  - ▶ Döviz Piyasaları
  - ▶ Para Piyasaları
  - ▶ Sermaye Piyasaları
- ❑ Türev İşlemler
  - ▶ Türev Ürün Çeşitleri Nelerdir?
  - ▶ Türev İşlem Fiyatlamalarında Kullanılan Araçlar Nelerdir?
  - ▶ Bireysel ve Kurumsal Müşteriler Neden Türev İşlemler Yaparlar?
  - ▶ Teminatlandırma (Başlangıç Teminatı, Sürdürme Teminatı, Margin Call)
  - ▶ Forward İşlemler
  - ▶ Döviz Swapları
- ❑ Opsiyon İşlemleri
  - ▶ Opsiyon İşlemlerinde Risk ve Getiri Kavramları
  - ▶ Opsiyon İşlemlerinin Kullanım Alanları Nelerdir?
  - ▶ Bireysel ve Kurumsal Müşteriler Neden Opsiyon İşlemi Yapar?
  - ▶ Opsiyon Çeşitleri (Vanilla, Egzotik, Payout)
  - ▶ Opsiyon İşlemlerinde Temel Kavramlar
  - ▶ Opsiyon Fiyatlarını Etkileyen Temel Kavramlar
  - ▶ Banka Hazineleri Opsiyon İşlemlerini Nasıl Fiyatlar?
  - ▶ Uygulamalı Opsiyon Fiyatlamaları
  - ▶ Implied Volatilite Kavramı
  - ▶ Başlangıç Teminatı, Sürdürme Teminatı, Margin Call
- ❑ Faiz Swapları
  - ▶ Çapraz Kur Swap (Cross Currency Swap) İşlemleri
  - ▶ Swap İşlemlerinin Kullanım Alanları Nelerdir?
  - ▶ Müşteriler Neden Faiz Swap İşlemleri Yapar?
  - ▶ Banka Hazineleri Faiz Swap İşlemlerini Nasıl Fiyatlar?
  - ▶ Uygulamalı Faiz Swap Fiyatlamalar
- ❑ Sabit Getirili Menkul Kıymetler
  - ▶ Tahvil ve Bono Piyasaları
  - ▶ BIST Nezdindeki İkincil Tahvil ve Bono Piyasaları
  - ▶ Hazine İhraçları
  - ▶ Tahvil ve Bono Çeşitleri
  - ▶ Durasyon
  - ▶ Konveksite
  - ▶ DVO1 Analizleri

## EĞİTİM YETKİNLİK İLİŞKİSİ

Davranışsal Yetkinlikler	Müşteri Duyarlılığı, Takım Çalışması ve İşbirliği, Analitik Düşünme ve Yaratıcılık
Yönetsel Yetkinlikler	Hızlı Karar Alma ve Çeviklik, Bilgi İzleme ve Operasyonel Takip, Sonuç Odaklılık, Koordinasyon, Denetleme
Mesleki/ Bankacılık Teknik Yetkinlikler	Mevzuat, İç Sistemler ve Denetim, Maliyet, Fiyatlama, İlişki Yönetimi, Stratejik İlişkiler ve Kilit Ortaklıklar Kurma, Raporlama ve Sunum, Kıyaslama, Global Zeka
Öz-Gelecek Yetkinlikleri	

Uygulama Yeri	Süre	Eğitim Görevlisi
Sanal Sınıf	3 gün	Güneş Kasap

Başlangıç Tarihi : 18.10.2021 - Bitiş Tarihi: 20.10.2021

TBB Üyeleri İçin Eğitim Ücreti: ₺ 750 - Diğer Kurumlar İçin Eğitim Ücreti: ₺ 840

- Fiyatlarımıza KDV Dahildir.