

# HAZINE YÖNETİMİ

(HZY)



# YATIRIM ÜRÜNLERİ VE HESAPLAMA YÖNTEMLERİ

## AMAÇ

Yatırım ürünlerinin özelliklerinin, işleyişinin, maliyet ve karlılık analizinin aktarılması hedeflenmektedir. Ayrıca; tüm ürünler için faiz- getiri ilişkisi, hesaplama yöntemleri, risk ve ürünleri etkileyen piyasa koşulları konularına da eğitimde yer verilecektir.

## ODAK NOKTALARI

#Yatırım Ürünleri #Finansal Enstrümanlar  
#Hesaplama Yöntemleri

## EĞİTİMDEN BEKLENEN SONUÇLAR

Bilir:Yatırım ürünlerinin özelliklerini, işleyişini bilir.

Anlar:Değişen piyasa koşullarının yatırım ürünlerini nasıl etkilediğini anlar.

Yapar:Hangi piyasa koşulunda, hangi yatırım ürününün avantajlı ya da dezavantajlı olacağını yorumlayıp aktarabilir.

## HEDEF KİTLE

Şube ve genel müdürlükten (hazine, fon yönetimi birimlerinde çalışanlar hariç) konuya ilgi ve ihtiyaç duyan tüm çalışanların katılımına uygundur.

## NOT

## İÇERİK

- Yatırım Ürünleri
  - Bonolar: Hazine Bonosu, Finansman Bonosu
  - Tahviller: Devlet Tahvili, Özel Sektör Tahvili, İskontolu ve Kuponlu Tahviller, Sabit ve
- Değişken Faizli Tahviller
  - Eurobondlar: Birikmiş Faiz, Temiz ve Kirlili Fiyat Hesaplamaları
  - Repo
  - Hisse Senetleri (Temettü ve Rüçhan Hakkı Hesaplamaları)
  - Yatırım Fonları
  - Döviz ve Kıymetli Madenler: Altın, Gümüş
- Yatırım Ürünlerinin Özellikleri, İşleyişi, Getiri Hesaplamaları
- Yatırım Ürünlerinin Vergisel Boyutu
- Piyasalardaki Hareketlerin Yatırım Ürünlerine Etkisi
  - Faiz Oranlarını Etkileyen Faktörler
  - Döviz Kurlarını Etkileyen Faktörler
  - Hisse Senedi Fiyatlarını Etkileyen Faktörler
  - Altın Fiyatlarını Etkileyen Faktörler

## EĞİTİM YETKİNLİK İLİŞKİSİ

Davranışsal Yetkinlikler	Müşteri Duyarlılığı, Mesleki Gelişim
Yönetsel Yetkinlikler	Bilgi İzleme ve Operasyonel Takip
Mesleki/ Bankacılık Teknik Yetkinlikler	Maliyet, Fiyatlandırma, Mevzuat
Öz-Gelecek Yetkinlikleri	

Uygulama Yeri	Süre	Eğitim Görevlisi
Sanal Sınıf	2 gün	Cenk İnceoğlu

Başlangıç Tarihi : 29.04.2025 - Bitiş Tarihi: 30.04.2025

TBB Üyeleri İçin Eğitim Ücreti: ₺ 3.000 - Diğer Kurumlar İçin Eğitim Ücreti: ₺ 3.400

- Fiyatlarımıza KDV Dahildir.



## 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
Meslekî/ 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 : 14.05.2025 - Bitiş Tarihi: 16.05.2025

TBB Üyeleri İçin Eğitim Ücreti: ₺ 4.500 - Diğer Kurumlar İçin Eğitim Ücreti: ₺ 5.100

- Fiyatlarımıza KDV Dahildir.

# UYGULAMALI TÜREV ÜRÜN ÇÖZÜMLERİ

## AMAÇ

Katılımcıların; piyasa koşulları çerçevesinde kullanabilecekleri türev ürünleri, avantaj ve dezavantajları ile tanımaları amaçlanmaktadır.

## ODAK NOKTALARI

#Türev Ürünler #Piyasalar #Maliyet #Fiyatlama

## EĞİTİMDEN BEKLENEN SONUÇLAR

Bilir: Piyasada kullanılan türev ürünlerin neler olduğunu bilir.

Anlar: Türev ürünlere ilişkin fiyatlamanın nasıl yapıldığını anlar.

Yapar: Söz konusu türev ürünlerin uygun müşterilere pazarlamasını yapar.

## HEDEF KİTLE

Konuya ilgi ve ihtiyaç duyan tüm çalışanların katılımına uygundur.

## NOT

## İÇERİK

- Türev Ürün Fiyatlama Matematiği
  - ▶ Taşıma Maliyeti-Swap Point
  - ▶ Teorik Fiyat
- Hedge-Spekülasyon-Arbitraj
- Forward (Faiz+Diğer Finansal Enstrümanlar)
- Futures (VIOP)
- Döviz Swapları
- Opsiyonlar
  - ▶ Opsiyon Fiyatlaması/Fiyatı Etkileyen Faktörler
  - ▶ Put-Call Paritesi
  - ▶ Vanilla Opsiyonlar/Trade Mekanizması
  - ▶ Egzotic Opsiyonlar
    - ✓ Barrier Opsiyonları
    - ✓ Digital Opsiyonlar
    - ✓ Touch Opsiyonlar
    - ✓ Koridorlar
    - ✓ Egzotic Barrier Opsiyonları
    - ✓ Opsiyon Stratejileri
    - ✓ Fiyatlar Yükselirken
    - ✓ Fiyatlar Düşerken
    - ✓ Durağan ya da Yüksek Volatilitite Beklentisinde
- Yapılandırılmış Ürünler
- Tüm Ürünlere İlişkin Avantaj ve Dezavantajlar



## EĞİTİM YETKİNLİK İLİŞKİSİ

Davranışsal Yetkinlikler	Müşteri Duyarlılığı
Yönetsel Yetkinlikler	Sonuç Odaklılık
Mesleki/ Bankacılık Teknik Yetkinlikler	Maliyet, Fiyatlama
Öz-Gelecek Yetkinlikleri	

Uygulama Yeri	Süre	Eğitim Görevlisi
Sanal Sınıf	3 gün	Saim Çelik

Başlangıç Tarihi : 11.06.2025 - Bitiş Tarihi: 13.06.2025

TBB Üyeleri İçin Eğitim Ücreti: ₺ 4.500 - Diğer Kurumlar İçin Eğitim Ücreti: ₺ 5.100

- Fiyatlarımıza KDV Dahildir.

# HAZİNE ÜRÜNLERİ VE YENİ NESİL BANKACILIK

## AMAÇ

Para piyasaları, sermaye piyasaları ve türev piyasaları ile bu piyasalarda kullanılan finansal enstrümanların müşteri ve banka açısından riskler ve avantajların örnek olaylar ile aktarılması amaçlanmaktadır.

## ODAK NOKTALARI

#Piyasalar #Finansal Enstrümanlar #Finansal Terminoloji #Vergi #Kar/ Zarar Hesabı

## EĞİTİMDEN BEKLENEN SONUÇLAR

Bilir:Finans piyasaları ve işleyişi ile kullanılan ürünleri bilir.

Anlar:Para, sermaye, türev piyasalarındaki gelişmeleri anlar ve yorumlar.

Yapar:Müşterilerden gelecek verileri değerlendirip piyasa şartlarına göre müşteriye yorum yapabilir, riskleri ve avantajları müşteriye aktarabilir.

## HEDEF KİTLE

Konuya ilgi ve ihtiyaç duyan tüm çalışanların katılımına uygundur.

## NOT

## İÇERİK

- Para Piyasası Ürünleri
- Repo
- Hazine Bonosu
- Finansman Bonosu
- VDMK
- Sermaye Piyasası Ürünleri
- Devlet Tahvili
  - ▶ TL- YP Devlet Tahvili
  - ▶ Kuponuz Devlet Tahvili
  - ▶ Kuponlu Devlet Tahvili
  - ▶ Hisse Senedi
  - ▶ Eurobond
- Vadeli İşlemler ve Opsiyon Borsası
- VİS Sözleşme Çeşitleri
- Türev Piyasa İşlemleri
  - ▶ Opsiyonlar
- Yeni Nesil Ürünler
- DCD İşlemleri
- Anapara Korumalı Mevduatlar
- Wedding Cake, Range Accrual, Double No Touch

## EĞİTİM YETKİNLİK İLİŞKİSİ

Davranışsal Yetkinlikler	Müşteri Duyarlılığı, Analitik Düşünme
Yönetsel Yetkinlikler	Hızlı ve Doğru Karar Alma, Bilgi İzleme
Mesleki/ Bankacılık Teknik Yetkinlikler	Maliyet, Fiyatlama
Öz-Gelecek Yetkinlikleri	

Uygulama Yeri	Süre	Eğitim Görevlisi
Sanal Sınıf	3 gün	Ogün Ölçer

Başlangıç Tarihi : 18.06.2025 - Bitiş Tarihi: 20.06.2025

TBB Üyeleri İçin Eğitim Ücreti: ₺ 4.500 - Diğer Kurumlar İçin Eğitim Ücreti: ₺ 5.100

- Fiyatlarımıza KDV Dahildir.

