

# HAZINE YÖNETİMİ

(HZY)



# PIYASA SİMÜLASYONU OYUNU

## AMAÇ

Katılımcıların, fon yönetimi kavramını ve içeriğini öğrenerek, hazine bölümünde yapılan işlemlerin neler olduğunu anlaması, Dünya ve Türkiye'de çalışan piyasaları tanıması, bilgisayarlı simülasyon desteğiyle sanal bir ortamda aktif olarak bir bankanın hazinesini yönetmesi ve piyasalarda işlem gerçekleştirme yoluyla bahsedilen tüm bu kavramları, işleyiş mekanizmalarını ve piyasa mantığını öğrenmesi amaçlanmaktadır. Katılımcılar Reuters ekranlarını tanıyacak, fiyatlama mantığını, arbitraj işlemlerini ve kar yaratma imkanlarını sanal ortamda gerçek işlemlerle öğreneceklerdir. Katılımcılar, gruplar halinde bir bankanın fon yönetimi bölümünü oluşturacak ve belirli süre için hazineyi yöneteceklerdir.

## ODAK NOKTALARI

#Aktif ve Pasif Yönetimi #Piyasalar #Hazine Yönetimi #Fiyatlama

## EĞİTİMDEN BEKLENEN SONUÇLAR

Bilir:Aktif ve pasif yönetiminin nasıl yapılacağını ve piyasaların çalışma sistemini bilir.

Anlar:Piyasalar gelen bilgiler doğrultusunda nasıl işlem yapılacağını anlar.

Yapar:Hazine ürünlerinin kullanımını gerçekleştirir.

## HEDEF KİTLE

Şube yöneticileri, şube yönetici adayları, bireysel ve perakende bankacılık pazarlama, kurumsal bankacılık, özel bankacılık pazarlama yönetici adayları, hazine (yeni başlayanlar), iç kontrol, risk yönetimi, teftiş kurulu, hazine operasyon bölümü çalışanlarının katılımına uygundur.

## NOT

Eğitim, bilgisayar uygulamalı olarak gerçekleştirilecektir.

## İÇERİK

- ❑ Parasal Sistemde Meydana Gelen Gelişmeler
  - ▶ Dünya'da Piyasalaşma Süreci
  - ▶ Türkiye'de Piyasalaşma Süreci
- ❑ Piyasa Kavramı ve Piyasalar
  - ▶ Mali Piyasalar
  - ▶ Organize Piyasalar
  - ▶ Tezgahüstü Piyasalar
- ❑ Hazine ve Dealing Room
  - ▶ Hazinesinin Fonksiyonları
  - ▶ Hazinesinin Bölümleri
- ❑ TL Pozisyon Yönetimi
  - ▶ Faiz Oluşum Süreci
  - ▶ MB Para Politikaları
- ❑ Döviz Pozisyon Yönetimi
  - ▶ Temel Kavramlar
    - ✓ Döviz Kuru
    - ✓ Döviz ve Efektif
    - ✓ Çapraz Kur
    - ✓ Kotasyon
    - ✓ Valor ve Ödemeler
  - ▶ Döviz Piyasası Ürünleri Fiyatlama Yöntemleri
  - ▶ Döviz Piyasası Katılımcıları
  - ▶ Döviz Piyasası Fonksiyonları
  - ▶ Döviz Pozisyonu ve Kur Riski
  - ▶ Döviz Kurunu Belirleyen Faktörler
    - ✓ Temel Analiz
    - ✓ Teknik Analiz
  - ▶ Türkiye'de Döviz Pozisyonu ile İlgili Mevzuat
- ❑ Menkul Kıymetler Bölümü
  - ▶ Kamu Menkul Kıymetleri
  - ▶ İhraç Yöntemleri
  - ▶ Repo ve Ters Repo Kavramı
  - ▶ Sabit Getirili Menkul Kıymetlerde Fiyatlama ve Finans Matematiği
    - ✓ Hazine Bonosu, Repo Hesaplamaları
    - ✓ Bileşik Faiz Uygulamaları
    - ✓ Tahvil Değerlemesi
- ❑ Finansal Piyasalarda Genel Müşteri Talepleri
  - ▶ Doğru Müşteri, Doğru Fiyatlama
  - ▶ Doğru Ürün, Doğru Müşteri
  - ▶ İtirazları Karşılama

## EĞİTİM YETKİNLİK İLİŞKİSİ

Davranışsal Yetkinlikler	Mesleki Gelişim ve Yenilenme, Takım Çalışması ve İşbirliği, Analitik Düşünme ve Yaratıcılık
Yönetsel Yetkinlikler	Hızlı Karar Alma ve Çeviklik
Mesleki/ Bankacılık Teknik Yetkinlikler	Mevzuat, Maliyet, Fiyatlama, Kıyaslama
Öz-Gelecek Yetkinlikleri	

Uygulama Yeri	Süre	Eğitim Görevlisi
TBB Eğitim Merkezi	3 gün	Saim Çelik

Başlangıç Tarihi : 7.9.2020 - Bitiş Tarihi: 9.9.2020

TBB Üyeleri İçin Eğitim Ücreti: ₺ 1.200 - Diğer Kurumlar İçin Eğitim Ücreti: ₺ 1.380

- Fiyatlarımıza KDV Dahildir.



# HAZİNE ÜRÜNLERİ VE YENİ NESİL BANKACILIK

## AMAÇ

Eğitimde; para piyasaları, sermaye piyasaları ve türev piyasaları ile bu piyasalarda kullanılan finansal enstrümanlar, müşteri ve banka açısından riskler ve avantajların örnek olaylar ile aktarılması amaçlanmaktadır.

## ODAK NOKTALARI

#Piyasalar ve İşleyişi #Finansal Enstrümanlar  
#Piyasalar Arasındaki Farklılıklar #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
  - ▶ Kuponsuz 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 Korunmalı Mevduatlar
- Wedding Cake, Range Accrual, Double No Touch

## EĞİTİM YETKİNLİK İLİŞKİSİ

Davranışsal Yetkinlikler	İletişim, Merak ve Keşfetme, Müşteri Duyarlılığı, Analitik Düşünme , İletişim, Güven Yaratma, Müşteri Duyarlılığı
Yönetsel Yetkinlikler	Hızlı ve Doğru Karar Alma , Bilgi İzleme
Mesleki/ Bankacılık Teknik Yetkinlikler	Maliyet, Fiyatlama, İlişki Yönetimi, Stratejik İlişkiler ve Kilit Ortaklıklar Kurma
Öz-Gelecek Yetkinlikleri	

Uygulama Yeri	Süre	Eğitim Görevlisi
TBB Eğitim Merkezi	2 gün	Ogün Ölçer

Başlangıç Tarihi : 26.10.2020 - Bitiş Tarihi: 27.10.2020

TBB Üyeleri İçin Eğitim Ücreti: ₺ 700 - Diğer Kurumlar İçin Eğitim Ücreti: ₺ 820

- Fiyatlarımıza KDV Dahildir.



## AMAÇ

Katılımcılara, menkul kıymetlerin ve türev ürünlerin fiyatlanması, risklerinin analiz edilmesi ve yönetilmesi ile ilgili temel ve ileri analiz yöntemleri anlatılmaktadır. Bankaların hazine birimleri tanıtılmakta ve gerçekleştirdiği fonksiyonlar detaylı olarak aktarılmaktadır. Hazine birimlerinde kullanılan veri sağlayıcılar ve kullanım özelliklerini tanımak eğitimin önemli amaçlarından bir diğeridir. Katılımcılar; banka hazinelerinin işleyişlerini, kullanılan enstrümanları, bu enstrümanların fiyatlama özelliklerini ve hazinelerin faaliyet gösterdiği piyasaları detaylı tanıma imkanına kavuşacaktır. Eğitim çok sayıda uygulama örneği ve simülasyonlar ile desteklenmektedir.

## ODAK NOKTALARI

#Mevzuata Hakimiyet #Fiyatlama #Hazine Ürünlerini Tanıma #Piyasaları Tanıma #Müşterilerle İletişim #Karlılık #Sözleşmeler #Kredi Limitleri #Teminatlandırma #Veri Sağlayıcılar #Rekabet #Türev İşlemler #Düzenleyici Kurumlar #Piyasa Yapıcılığı #Likidite #Finansal Risk Yönetimi

## EĞİTİMDEN BEKLENEN SONUÇLAR

**Bilir:**Bankacılık Kanunu ve ilgili mevzuatı, iç prosedürleri bilir. Banka hazinelerinin faaliyet gösterdiği piyasaları bilir. Bankaların ilişkide olduğu yasal düzenleyici otoriteleri bilir. Yabancı veri sağlayıcıları bilir. Hazine ürünlerini bilir.

**Anlar:**Banka hazinelerinin birbirleri ile ilişkilerini anlar. Banka hazinelerinin müşteriler, piyasalar ve yasal otorite niteliğindeki kurumlar ile ilişkilerinin nasıl yürütüldüğünü anlar. Türev işlemlerin nasıl fiyatlandığını anlar. Finansal risklerin nasıl yönetildiğini anlar. Hazine enstrümanlarının nasıl fiyatlandığını anlar. Piyasa jargonunu 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 kurar. Müşterilerin kredi limitlerinin oluşturulmasında ve sözleşme hazırlanmasında aktif rol alır. Yabancı veri sağlayıcıları ve fiyatlayıcıları etkin kullanır. Piyasalardaki hareketleri etkin bir şekilde yorumlar.

## HEDEF KİTLE

Hazine ürünlerinin fiyatlanması ve analizi için hizmet veren tüm hazine bölümü çalışanları, hazine ürünlerinin risklerini ölçen ve denetleyen risk yönetimi, teftiş, iç kontrol çalışanları, hazine operasyon birimi, teminat yönetimi birimi çalışanları ve konuyu derinlemesine öğrenmek isteyen tüm çalışanların katılımına uygundur.

## NOT

Eğitimin bir günü bilgisayar uygulamalı olarak gerçekleştirilecektir.

## İÇERİK

- Banka Hazinelerinin Faaliyet Gösterdiği Piyasalar ve Dinamikler
  - ▶ Finansal Piyasalar
  - ▶ Türkiye ve Dünya'da Kullanılan Finansal Enstrümanlar
  - ▶ Hazine Ürünlerindeki Yeni Trendler ve Fırsatlar
  - ▶ Hazine Yönetiminde Artan Risk ve Ölçüm İhtiyacı
- Hazine Biriminde Yer Alan Masalar, Görev ve Sorumlulukları
  - ▶ Döviz Masası
  - ▶ Likidite Masası
  - ▶ Yerli/ Yabancı Sabit Getirili Menkul Kıymetler Masası
  - ▶ Türev İşlemler Masası
  - ▶ Hazine Satış ve Pazarlama Masası
  - ▶ Aktif Pasif Masası
  - ▶ Orta Ofis (Middle Office)
  - ▶ Arka Ofis (Back Office)
- Hazine Birimlerinde Kullanılan Yerli ve Yabancı Data Sağlayıcılar ve Hesaplama Ekranları
- Hazine Ürünlerinin Fiyatlanması
  - ▶ Sabit Getirili Menkul Kıymetler: Fiyatlanması ve Analizi
    - ✓ Temel Tanımlar ve Kavramlar
    - ✓ Bugünkü Değer (PV), Gelecekteki Değer (FV), İç Verim Oranı, İskontolu Bono, Sabit Kuponlu Bono, FRN (Değişken Kuponlu Bono)
    - ✓ Verim Eğrisi Analizi, Durasyon, Konveksite
    - ✓ Türk Hazinesinin İhrac Ettiği Menkul Kıymetler
    - ✓ TL Menkul Kıymetler (İskontolu Bono, Kuponlu Tahviller, FRN)
    - ✓ YP Menkul Kıymetler (Eurobondlar, İç Piyasaya Satılan Tahviller)
    - ✓ Getiri Menkul Kıymetlerin Fiyatlanması ve Risk Analizi
    - ✓ İskontolu Menkul Kıymetler
    - ✓ Fix Kuponlu Tahviller
    - ✓ FRN (Değişken Faizli Tahviller)
    - ✓ Eurobond Menkul Kıymetler
  - ▶ Döviz Piyasaları ve Dövizli İşlemler
  - ▶ Likidite İşlemleri
  - ▶ Türev Ürünlerin Fiyatlanması ve Analizi
- Vanilla Tipi Opsiyonlar
- Egzotik Opsiyonlar
- Payoutlu Opsiyonlar
- Yapılandırılmış Hedging Ürünleri
- Yapılandırılmış Yatırım Ürünleri
- Opsiyon Stratejileri
- Anapara Garantili Yatırım Ürünleri
  - ▶ Döviz Swapları
  - ▶ Faiz Swapları
- Faiz Swapları (Interest Rate Swaps-IRS)
- Çapraz Kur Swapları (Cross Currency Swaps – Basis Swaps)
- Çap/ Floor
- Swaption
- Yapılandırılmış Faiz Opsiyonları
- Teminat Yönetimi ve Limit Sistemlerinin Kurulması
  - ▶ Risk Bazlı Teminat Yönetim Sistemi Kurulması
  - ▶ Teminat Yönetim Sisteminin Enstrüman, Vade ve Döviz Cinsi Bazında

## Farklılaştırılması

- ▶ Çok Katmanlı ve Esnek Limit Sistemleri
- ▶ Limit Türleri ve Genel Özellikleri
- ▶ Risk Bazlı Limitler

## EĞİTİM YETKİNLİK İLİŞKİSİ

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

Uygulama Yeri	Süre	Eğitim Görevlisi
TBB Eğitim Merkezi	3 gün	Güneş Kasap

Başlangıç Tarihi : 2.11.2020 - Bitiş Tarihi: 4.11.2020

TBB Üyeleri İçin Eğitim Ücreti: ₺ 1.098 - Diğer Kurumlar İçin Eğitim Ücreti: ₺ 1.278

- Fiyatlarımıza KDV Dahildir.