

EĞİTİM KAPSAMI

- + Opsiyon Türleri
- + Fiyatlama Modelleri
- + Varantlar & Risk Metrikleri
- + Yaygın Stratejiler
- + Teminatlandırma ve RiskYönetimi

**Opsiyonlar, Varantlar:
Stratejiler,
Fiyatlama,
Hedging,
Teminatlandırma...**

**İstanbul
11 Aralık 2010**

Eğitmenler:

Doç.Dr.K.Evren Bolgün



Serhat Güven, FRM



Eğitim Hakkında: Küresel finansal krizde yaşanan aşırı hareketlerin ardından piyasalarda düşen volatilité ve ülkemizde Vadeli Opsiyon Borsası'nın gelişimi ile beraber önemi her geçen gün daha da artmakta olan "Opsiyon Piyasaları" tüm yönleri ile bilgisayar uygulama desteğinde ele alınacaktır. Eğitim kapsamında opsiyon fiyatlama modelleri, temel & ileri opsiyon stratejileri, tarihsel-gösterge (implied) volatilité ilişkileri, volatilité yüzeylendirme, opsiyon portföylerinde risk yönetimi ve teminatlandırma esasları, Varantlar ve risk metrikleri gibi farklı konular güncel piyasa örnekleri ile incelenecektir.

Katılımcı Profili: Kurumların risk yönetimi, hazine, teftiş kurulu, iç kontrol ve denetim birimleri ile özel emeklilik şirketleri ile fon yönetimi, portföy yönetimi çalışanları, KOBİ'lerin finansman yetkilileri, uluslararası alanda faaliyetleri bulunan holdinglerin kurumsal finansman, mali kontrol, stratejik planlama yetkilileri ile kamu kurumu uzmanları katılmalıdır.

Eğitim Dökümanları: Güncel Eğitim Notları, Uygulama Dosyaları, Çeşitli Akademik Makaleler

İçerik:

- I. Opsiyon Türleri
 - a. Avrupa Tipi Opsiyonlar
 - b. Amerikan Tipi Opsiyonlar
 - c. Asya Tipi Opsiyonlar
 - d. Dijital Opsiyonlar
 - e. Bariyerli Opsiyonlar
 - f. Quanto Opsiyonlar
 - g. Caps/Floors
- II. Opsiyon Stratejileri
 - a. Guts
 - b. Butterfly
 - c. Condor
 - d. Straddle
 - e. Strangle
 - f. Risk Reversal
- III. Opsiyon Fiyatlama Modelleri
 - a. Binomial Tree
 - b. Black & Scholes
 - c. Trinomial Trees & Adaptive Mesh Model
 - d. Numerical Methods
 - e. Monte Carlo & Quasi Monte Carlo

- f. Risk Yönetimi ve Teminatlandırma
 - i. VaR bazlı metodoloji
 - ii. SPAN yaklaşımı
 - iii. Delta-Vega Yaklaşımı
- IV. Uygulamalar
 - a. Greek-Nötr Portföy Oluşturma
 - b. Opsiyon Portföyü Teminat Hesaplaması
 - c. Türk Varant Piyasası

Eğitim Bilgileri

Yer : TBB Eğitim Merkezi 19 Mayıs
Caddesi No:1, Golden Plaza Kat:8
Şişli/İstanbul
Tarih : 11 Aralık 2010
Saat : 09:30 - 16:30
Ücret : 300 TL

Kayıt ve Rezervasyon

Telefon : (212) 216 54 84
e-posta : Sn.Bengü Delen
BenguD@garanti.com.tr

Diğer Bilgiler

Eğitim ücreti Risk Yöneticileri Derneği adına kayıtlı aşağıdaki banka hesabına yatırılmalıdır;

Hesap Adı: Risk Yöneticileri Derneği
Garanti Bankası Levent Şubesi 401-6687159

Eğitim ücretine, eğitim notları (yemek hariç) dahildir. Dernekler yasası gereği derneğimiz KDV'den muaftır, katılımcılara "Dernek Gelir Belgesi" düzenlenerek teslim edilecektir. Eğitim sonunda katılımcılara "Katılım Sertifikası" verilmektedir. Eğitim ücreti yatırılmadan kesin kayıt işlemi yapılamaz. Kontenjanımız 30 kişi ile sınırlıdır. Kontenjan dolduktan sonra yatırılan ücretler iade edilerek kayıt iptal edilir. Eğitim tarihinden 1 hafta öncesine kadar yapılan iptallerde eğitim ücretinin tamamı iade edilir. Bu tarihten sonra yapılan iptallerde ücret geri iade edilmez; ancak katılımcı ismi değişikliği yapılabilir. Risk Yöneticileri Derneği kayıt yaptırılan eğitimin yerini, gününü ve saatini önceden haber vermek şartıyla değiştirebilir veya iptal edebilir. İptal veya erteleme durumunda eğitim ücreti katılımcıya iade edilir. Ödemeye ilişkin dekontun e-mail ile gönderilmesi suretiyle katılım kesinleştirilmiş olacaktır.

Son Başvuru Tarihi: 6 Aralık 2010