

Finansal Matematik-Video (Seviye 1 - Seviye 2)

EĐİTMEN

Doç.Dr.Evren Bolgün

AMAÇ

Eđitimin amacı, finansal alım/satım işlemlerinde kullanılan matematiksel yaklaşımların katılımcılara aktarılması ve bu yaklaşımların finansal stratejilerde nasıl etkin bir şekilde kullanıldığının incelemesidir. Bu sayede katılımcıların finansal problemlerin çözümüne daha sistematik bir şekilde yaklaşmasının sağlanması amaçlanmaktadır.

Sonuç olarak katılımcılar finansal matematiğin mantığını ve finasta hangi alanlarda nasıl uygulanabileceğini öğreneceklerdir. Finansal açıdan pozisyonların maliyetlerin hesaplanması, finansal ürünlerin nakit akışlarının belirlenmesi ve değerlendirilmesi çeşitli örneklerle gösterilmektedir.

ODAK NOKTALARI

#Bileşik Faiz #Sürekli/Dönemsel Faiz #İskontolama #Menkul Kıymet Değerlemesi #İVO

EĐİTİMDEN BEKLENEN SONUÇLAR (ÖĐRETİMSSEL ÇIKTILAR/KAZANIMLAR)

Bilir : Faiz Kavramını ve Temel Finansal Matematik İlkelerini Bilir.

Anlar : Menkul Kıymetlere Ait Faiz/Fiyat İlişkilerini Anlar.

Yapar : Temel Finansal Ürünlere Yönelik Fiyatlama/Değerleme İşlemlerini Yapar.

İÇERİK

- Paranın Zaman Deęeri ve Faiz-Getiri Kavramları **(Seviye 1)**
 - Yıllık Basit-Nominal-Bileşik Faiz
 - Reel Faiz, Taylor Faiz Kuramı
 - Aritmetik Getiri
 - Geometrik Getiri
 - TCMB Faizleri (Politika Faizi, Faiz Koridoru,..vs)
- Faiz Oranının Belirlenmesinde Teorik Yaklaşımlar? **(Seviye 1)**
 - Klasik Yaklaşım (Ödünç Verilebilir Fonlar Kuramı)
 - Keynesyen Yaklaşım (Likidite Tercihi Kuramı)
- Faizlendirme ve İskontolama İlkeleri **(Seviye 1)**
 - Tek Bir Nakit Akışının Gelecekteki Deęeri (Mevduat, Spot Kredi, vs.)
 - Gelecekteki Bir Nakit Akışının Bugünkü Deęeri Yaklaşımı (Hazine Bonosu, İskontolu Bono, Kuponsuz Devlet Tahvili, vs.)
- Anüite Hesapları (Ana Para ve Faiz Tutarlarının Belirlenmesi) **(Seviye 1)**
- Borçlanma ve İtfa Nakit Akışlarının Düzenlenmesi **(Seviye 1)**
 - Kuponlu Devlet Tahvilleri, Diğer Kuponlu Sabit Menkul Kıymetler
 - Annüiteli Krediler (Tüketici Kredileri, Konut Kredileri, vbg.)
- Getiri (Verim) Eğrisi Analizi **(Seviye 2)**
 - Getiri Eğrisinin Para Politikası ile İlişkisi
 - Getiri Eğrisinin Merkez Bankaları İçin Anlamı
 - Getiri Eğrisinin Beklentilerle İlişkilendirilmesi
 - Getiri (Verim) Eğrisi Modelleri
- Proje Deęerlendirmede Matematiksel Yaklaşımlar **(Seviye 1)**
 - Yatırımı Geri Ödeme Dönemi Metodu
 - İskontolanmış Yatırımı Geri Ödeme Dönemi Metodu
 - İç Verim Oranı Metodu
 - Bugünkü Deęer Metodu
- İstistiksel Analizler **(Seviye 2)**

- Tanımlayıcı İstatistikler (Mod, Medyan, Ortalama)
- Kurtosis, Skewness, Değişim Katsayısı Analizleri

- Volatilite Hesaplamaları **(Seviye 2)**
 - EWMA (Üssel Ağırlıklık Hareketli Ortalama)
 - GARCH

- Korelasyon-Kovaryans Analizleri **(Seviye 2)**