

Hisse Senedi Türev İşlemleri-Sınıf (Seviye 1/1 Gün - Seviye 2/Gün)

EĞİTMEN

Doç.Dr.Evren Bolgün

AMAÇ

Türev ürünlerin kullanımı çok eskilere dayanmakla beraber özellikle son 20 yılda yaşanan finansal dalgalanmalar bu alandaki gelişimi hızlandırmıştır. Günümüzde türev ürünler risk yönetimi, korunma ve spekülasyon amaçlarla kullanılabilir. Bu eğitimde katılımcılara, vadeli endeks, vadeli hisse senedi, hisse senedi opsiyonları, hisse/endeks varantları,..vs gibi temel hisse türev ürünlerin yapısı, özellikleri, fiyatlanması ve analizi ile ilgili bilgiler verilmekte ve risklerden korunmak için türev ürünleri nasıl kullanacakları anlatılmaktadır.

Eğitim sırasında aktarılan örneklerle spekülasyon, hedging (korunma) arbitraj işleminin şekilleri ve yapıları uygulamalı olarak gösterilmektedir. Detaylı biçimde VİOP ürünlerinin özellikleri anlatılmaktadır. Viop ürünlerinin kullanım alanları, fiyatlanmasında ve analizinde kullanılan yöntemler uygulamalı olarak aktarılmaktadır. Hedge ve spekülasyon amaçlı Viop kontratlarının hangi stratejiler ile kullanılabileceği anlatılmaktadır.

ODAK NOKTALARI

#VİOP #Hisse Varantları #Hisse Opsiyonu #Vadeli Endeks Kontratları #Vadeli Hisse Senedi

EĞİTİMDEN BEKLENEN SONUÇLAR (ÖĞRETİMSSEL ÇIKTILAR/KAZANIMLAR)

Bilir : Hisse Senedi Türev Ürünlerine Ait Temel Özellikleri Bilir.

Anlar : Vadeli Hisse Senedi/Endeks ve Hisse Senedi Türev Stratejilerini Anlar.

Yapar : Hisse/Endeks Türev Ürünlerine Yönelik Risk Yönetimi İşlemlerini Yapar.

İÇERİK

- Vadeli İşlem (Futures) Sözleşmelerine Giriş **(Seviye 1)**
 - Tanım, Tarihçe, Faydaları
 - Vadeli Piyasaların Kullanım Alanları (Korunma,Spekülasyon,Arbitraj)
 - Spot ve Vadeli Fiyat İlişkisi
 - Düz ve Ters Piyasalar (Contango, Backwardadion)
 - Açık Pozisyon Analizi
 - Uzlaşma Yöntemleri
 - Dünya ve Türkiye Vadeli İşlem İstatistikleri (BIS,VİOP,CME,.vs.)

- Vadeli Piyasalar ile Risk Yönetimi Esasları **(Seviye 1)**
 - Risk Yönetimi Temel Kavramları
 - Risk Yönetimi Uygulamaları

- Endeks/Hisse Senedi Vadeli Kontratları ve Uygulamaları **(Seviye 1)**
 - VİOP ve Yurtdışı Vadeli Endeks Özellikleri ve 'Teorik Fiyat' Kavramı
 - VİOP Hisse/Endeks Vadeli Yatırım Örnekleri
 - Vadeli Piyasalarda Beklenti Yönetimi
 - Portföylerde Sistemik Risk Yönetimi (β)
 - Arbitraj İşlemleri
 - Portföy Sigortalaması
 - Spread Uygulamaları

- Endeks/Hisse Varant İşlemleri ve Uygulamaları **(Seviye 1)**
 - Varant Nedir?
 - Varant Özellikleri
 - Varant Dinamikleri
 - Varant Pozisyonu Riskleri
 - Varant İşlem Esasları
 - Varant Fiyat Tesbiti
 - Varant Alım/Satım Stratejileri
 - Varantlarla Yatırım Portföyü Oluşturulması

- Hisse/Endeks Opsiyon Piyasasına Giriş **(Seviye 1)**

- Opsiyon Piyasası Özellikleri
 - Alım ve Satım Opsiyonları, Opsiyon Terminolojisi
 - Opsiyon Tipleri ve Kullanım Alanları
 - Opsiyon Prim Duyarlılıkları "Option Greeks"
 - Karda/Zararda ve Başabaş (ITM/OTM ve ATM) Opsiyonlar (Moneyness)
 - VİOP Hisse/Endeks Opsiyon Piyasası İşlemleri
- Opsiyon Fiyatlama Modelleri **(Seviye 2)**
 - Black & Scholes Modeli,
 - Monte Carlo Simülasyon Modeli
- Temel Opsiyon Stratejileri **(Seviye 1)**
 - Uzun Call
 - Uzun Put
 - Kısa Put
 - Kısa Call
 - Artış Yönünde Yayılma
 - Azalış Yönünde Yayılma
 - Uzun Kelebek Stratejisi
 - Kısa Kelebek Stratejisi
- Egzotik Opsiyon Türleri **(Seviye 2)**
 - Binary (Dijital) Opsiyonlar
 - Çift Bariyerli (Double No Touch) Opsiyonlar
 - Knock - In Opsiyonlar
 - Knock - Out Opsiyonlar
- Oynaklık (Volatilite) Analizleri, Volatilite Stratejileri **(Seviye 2)**
 - Vadeli Piyasalarda Yatırım Prensipleri **(Seviye 1)**