

FİNANSAL PİYASALARDA TAHMİN TEKNİKLERİ EĞİTİMİ (SİMÜLASYONLU)

Finans dünyasındaki değişkenlerin gelecekte nasıl davranacaklarını tahmin edebilmek için, bu değişkenleri açıklayan olasılık dağılımlarının iyi belirlenmesi gerekmektedir. Bu olasılık dağılımları yardımıyla, çok sayıda alternatif senaryolar oluşturmak için çeşitli simülasyon yöntemleri ve stokastik denklemler yardımıyla ilgili finansal değişkenin beklenen değeri ve etrafındaki sapmalar (varyans) tahmin edilmektedir. **Gelecekteki süprizlere karşı korunmak için volatilitenin iyi tahmin (forecast) edilmesi çok önemlidir.** Esasında yüksek volatilitenin özellikle riskten kaçınan (risk averse) bireysel ve kurumsal yatırımcıların finansal taleplerini olumsuz etkilediği de bilinen bir gerçektir.

Örneğin herhangi bir finansal pozisyona girme öncesinde **\$/TRY'nin önümüzdeki 1 ay içerisinde 7.4630-8.5750 aralığında kalma olasılığı %70 iken, 7.5000 seviyesinin altına inme olasılığı %31.44'dür. Öte yandan \$/TL'nin önümüzdeki 1 ay içerisinde 8.0000 seviyesinin üzerine çıkma ihtimali %50.6'dır.** (Spot \$/TL: 7.8000) Gram Altın'ın önümüzdeki ay içerisinde 413.92TL ile 532.68TL arasında kalma olasılığı %70'dir. Gram Altın spot fiyatının önümüzdeki 1 ay içerisinde 500.00TL fiyatının üzerine çıkma ihtimali %40.32'dir. (Spot Gram Altın: 462.25TL) BİST.100 endeksinin önümüzdeki 1 ay içerisinde 1250 desteğinin altına düşme olasılığı %43.48 ve 1350 direncinin üzerine çıkma ihtimali ise %46.16'dir şeklindeki tahminleri yapabilmek için bu eğitim kapsamında tüm yönleriyle incelenen finansal modelleri ve analiz sonuçlarını doğru yorumlayabilmek başarılı bir yatırımın olmazsa olmazlarıdır.

Döviz, Endeks, Hisse Senetleri üzerine Opsiyon, Varant işlemleri yapacaksanız veya Spot Hisse Senedi pozisyon alacaksanız yatırım vade perspektifiniz doğrultusunda işlem öncesinde en uygun dayanak varlık kullanım fiyatlarının tespit edilmesi, opsiyon, varant bariyer seviyelerinin belirlenmesi büyük önem taşımaktadır. Alım veya Satım Varant pozisyonları alınması öncesinde belirlenen seviyelere denk gelen dayanak varlık olasılık düzeyleri pozisyonlarının karlılık seviyesini olumlu yönde etkileyecektir.

Eğitim içerisinde;

- Hangi volatilité modelinin volatilité alım/satım işlemlerinde kullanılacağı hangi piyasada işlem yapılacağı ile yakından ilişkilidir.
- Döviz piyasaları stokastik volatilité ortamına uygun hareket sergilemektedir.
- Faiz piyasaları faiz düzeylerine dayalı bir volatilité döngüsü içerisinde bulunmaktadır.
- Hisse senetleri kısa vadede ani sıçrama ve uzun zaman içerisinde volatilité erimesi söz konusudur.

gibi bir çok teknik soru teorik ve uygulamalı bir şekilde irdelenerek analiz edilmektedir. Eğitiminde sunulan teorik bilginin yanında katılımcılarla Döviz Kuru, Hisse Senedi, Altın, BIST30 Endeksi gibi çeşitli finansal risk faktörleri üzerine Excel tabanlı, Hoadley Investment & Trading programı ile ilgili finansal değişkenler üzerinde yapılan simülasyonlarla etkin bir fiyat tahminlemesi gerçekleştirilmektedir. Ayrıca Finnet Portfolio Advisor uygulaması üzerinden de BİST endeksi içerisinde oluşturulan çeşitli portföylere dair getiri-risk analizleri yapılacaktır. Bu noktadan sonra yapılacak olan yatırım stratejileri ile çok daha etkin bir yatırım ortamı oluşturulabilmektedir. Dolayısıyla, eğitim kapsamında gerçekleştirilen uygulamalar sayesinde katılımcılar istedikleri ölçüde kolaylıkla kur, hisse senedi, endeks fiyat seviye olasılıklarını oluşturarak portföy risk-getiri performanslarını profesyonel bir şekilde analiz edebilmektedirler.

Eğitimin Süresi

Eğitimin süresi satın aldığınız tarihten itibaren **X aydır.**

Eğitimimizi satın aldığınız andan itibaren, Borfin'e üye girişi yaparak izlemeye başlayabilirsiniz. Eğitim, www.borfin.com.tr de videolarla sunulmaktadır.(Eğitim videoları indirilemeyecektir.)

Eğitimin Amacı

Katılımcılara Excel üzerine eklenerek kullanılacak olan Hisse Senedi, Döviz Kuru, Endeks volatilité ve istatistik analizleri ile çeşitli muhtemel fiyat simülasyonu yapılması suretiyle gelecekteki olası fiyat olasılıkları programının yardımı ile hesaplanmaktadır. Böylece türev portföylerinde yatırım öncesinde çok daha etkin bir şekilde fiyat tespit edilebilmesinin nasıl mümkün olabileceği uygulamalı olarak gösterilmektedir.

Ne Kazandıracak

Eđitim sonunda katılımcılar, tüm finansal tahmin modelleri hakkında detaylı bilgi sahibi olmalarının yanında, yatırım öncesi ve yatırım süresince deđişen piyasa şartlarına uygun olarak gerçekleştirecekleri finansal simülasyonlar yardımıyla gelecekteki fiyat oluşumlarına yakın finansal tahminler yapabileceklerini öğrenerek daha isabetli bir yatırım imkanına kavuşacaklardır.

Kimler Katılmalı

Hisse Senedi, Altın ve Döviz piyasalarında bireysel veya kurumsal olarak yatırım yapan/yapmayı düşünen ya da finansal yatırımlarına daha isabetli yön vermeyi arzu etmekte olan herkesin katılmasını tavsiye ediyoruz.

Eđitim Programı

- Finansal Piyasa Göstergeleri
- Risk Kavramı (Sistemik-Sistemik Olmayan)
- Temel İstatistik Kavramları
- Volatilité & Korelasyon Tahminlemesi
- Finansal Varlıklarda Monte Carlo Simülasyonu
- Stokastik Süreçler
- Finansal Tahmin Uygulaması (Kur ve BIST Endeks Simülasyonu)
- Alım/Satım Portföylerinde Volatilité Yönetimi
- Genel Deđerlendirme