

PORTFÖY YÖNETİMİ TEKNİKLERİ EĞİTİMİ (YAZILIM UYGULAMALI)

Portföy Yönetimi Teknikleri eğitiminde, risk-getiri tercihleri doğrultusunda yatırımcıların portföy getiri hedefleri ve hisse senedi portföy sınırlamaları doğrultusunda ortalama-varyans optimizasyonu yapılmak suretiyle etkin sınır çerçevesinde detaylı risk analizleri hesaplanarak etkin hisse senedi dağılımları oluşturulmaktadır.. Bilindiği üzere Portföy Yönetimi, finansal yatırımların varlık sınıflarına dağılımlarına karar verilmesi, risk yönetimi, portföy çeşitlemesi ve piyasa zamanlaması gibi stratejilerle yönetilmesi kavramlarını içermektedir. Bu eğitimin amacı; yatırım teorisini tanıtmak, yatırım kararları alınırken dikkate alınması gereken hususlar hakkında yatırımcıları bilgilendirmek, portföy yönetimini gerek teorik gerekse de uygulama bazında detaylı olarak değerlendirmeyi içermektedir. Bu eğitim sonucunda hedeflenen, katılımcılara finansal piyasalara, hisse senetlerine daha geniş bir bakış açısı (risk-getiri odaklı) ile bakmaların, finans ve yatırım alanında günümüzdeki gelişmeleri daha iyi yorumlamalarını sağlamaktır. "

Eğitiminde, teorik bilgilerin aktarımlarının dışında uygulamalarda "Finnet Portfolio Advisor" ürünü kullanılarak Markowitz Portföy Optimizasyonuna ilişkin birçok örnekler aktarılacaktır. BIST içerisindeki halka açık firmalar üzerinden uygulanan excel tabanlı çalışan "Hoadley Portolio Optimizer Pro (HPO)" programı ile seçilen hisse senetleri üzerinde yapılacak optimizasyonlarla etkin bir hisse senedi portföy seçim stratejileri oluşturularak bu stratejilerin risk-getiri perspektifindeki etkinliklerini görme imkânları sunulmaktadır. Dolayısıyla, eğitim kapsamında gerçekleştirilen zengin içerikte hazırlanan uygulamalar sayesinde katılımcılar istedikleri ölçüde kolaylıkla hisse senedi seçim stratejileri oluşturup risk getiri performanslarını analiz edebilmektedir.

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

Bu eğitimin amacı; çeşitli finansal ürün örnekleri üzerinden portföy ve yatırım teorilerini kısaca tanıtmak, müşterilere yatırım tavsiyeleri verirken dikkate alınması gereken hususlar hakkında yatırım danışmanlarını bilgilendirmek, yatırımcıları portföy/risk yönetimi temel kavramlarını incelemeye yöneltmek ve doğru piyasa analizlerinin yapılmasını sağlamaktır. Bu eğitim sonucunda hedeflenen, katılımcılara finansal piyasalara, yatırım fon dünyasına, bireysel emeklilik fonlarına, hisse senetlerine, sabit getirili enstrümanlara daha geniş bir perspektiften bakış açısı (risk-getiri odaklı) geliştirerek bakılabilmesini sağlamak, finans ve yatırım alanındaki güncel gelişmeleri daha iyi biçimde yorumlamayı sağlamak olacaktır.

Ne Kazandıracak

Eğitim sonunda katılımcılar, portföy yönetimi teorik yaklaşımına göre hisse senedi seçimini nasıl yapabileceklerini öğrenecekler.

Kimler Katılmalı

Sermaye piyasasında bireysel veya kurumsal olarak yatırım yapan/yapmayı düşünen ya da yatırımlara yön veren herkesin katılmasını tavsiye ediyoruz.

Eğitim Programı

- Portföy Yönetimi Prensipleri**
 - ✓ Portföy Kavramı
 - ✓ Portföy Yönetimi Süreci
 - ✓ Varlık Dağılımı & Portföy Çeşitlendirmesi
 - ✓ Risk & Beklenen Getiri Analizi
 - ✓ Yatırımcı Risk İştahının Tespiti ve Yatırımcı Risk Profilinin Tanımlanması
- Yatırım Araçları, Finansal Risk - Getiri Hesaplamaları**
 - ✓ Finansal Varlıklarda Beklenen Getiri & Risk Kavramı

- ✓ Yatırım Ürünleri, Özellikleri, Kullanımı (Hisse Senedi, Tahvil, Varant)
- ✓ Yatırım Fon Analizleri (BES Fonları, MKYF Değişken, Borçlanma Araçları, Fon Sepeti, Hisse Senedi Fonları)
- ✓ Yatırım Planlaması, Kişisel Varlık Yönetimi

3. Geleneksel Portföy Yönetimi

- ✓ Geleneksel Portföy Yönetimi Aşamaları
- ✓ Portföy Getirisi, Çeşitlendirme Etkisi

4. Modern Portföy Yönetimi

- ✓ Modern Portföy Modeli, Varsayımları
- ✓ Markowitz Ortalama-Varyans Modeli
- ✓ Sermaye Varlıklarını Fiyatlandırma Modeli (CAPM) Varsayımları
- ✓ Etkin Piyasalar Hipotezi
- ✓ BİST.30 Örnek Portföy Risk/Getiri Analizi, Portföy Optimizasyonu (Simülasyon Çalışması)
- ✓ Arbitraj Fiyatlandırma Modeli
- ✓ Black-Litterman Modeli

5. Portföy Yönetimi Stratejileri

- ✓ Pasif & Aktif Portföy Yönetimi
- ✓ Satın Al ve Elde Tut, Maliyeti Ortalama Stratejisi
- ✓ Sabit Değer, Değişken Oran Stratejisi
- ✓ Endeks Fon Stratejisi
- ✓ Smart Beta Stratejileri
- ✓ Robo Danışmanlık

6. Portföy Performansının ve Riskinin Ölçülmesi

- ✓ Sharpe ve Sortino Oranı
- ✓ Treynor ve Bilgi Oranı
- ✓ Jensen Oranı ve Maksimum Geri Çekiliş
- ✓ Piyasa Zamanlaması
- ✓ BİST Hisse Portföyü Risk Ölçümleri (RmD, Marjinal Risk, Risk Paritesi,..vs)

7. Sonuç ve Değerlendirme

