

TAHVİL YATIRIM TEKNİKLERİ

Bu eğitim kapsamında; finansal matematik, faiz hesaplamaları (basit, bileşik, sürekli), farklı nakit akış seçeneklerine dayalı anuite hesaplamaları, aritmetik, geometrik, para ağırlıklı getiri kavramları, bono/tahvil ürünlerine yönelik tüm temel kavramlar örnek uygulamalar eşliğinde ele alınmaktadır. Bu eğitimde, tahvil özellikleri, tahvil değerlemesinin genel esasları, tahvil getirisi, vadeye kadar olan getiri ve tahvil riskini ölçme aracı olan durasyon, modifiye durasyon, spread durasyon, konveksite,..vs. gibi bir çok çeşitli risk ölçütleri örnekler eşliğinde incelenmektedir. Vade yapısı, verim eğrisi analizleri ve tüm verim eğrisi modelleri güncel piyasa verileri eşliğinde katılımcılar ile paylaşılmaktadır. Eğitim içerisindeki konular çok sayıda örneklerle açıklanmaktadır.

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 Matriks üzerinden Türkiye Tahvil Piyasası İşlemleri, Verim Eğrisi Modelleri ve Analizi, Excel dosyaları üzerinden Finansal Matematik Uygulamaları, Tahvil Yatırım Stratejileri gerçek zamanlı fiyatlama örnekleri ile aktarılacaktır. Finnet Bono/Tahvil Expert yardımcı programı ve Finnets Trade Simulator Yazılımı ile de tahvil piyasasına yönelik gerekli piyasa hazırlıkları gibi bir çok detaylı çalışmaların anlatımı amaçlanmaktadır.

Ne Kazandıracak

Eğitim sonunda katılımcılar, yurtdışı ve yurtiçi farklı faiz ödeme özelliklerine haiz tüm tahvil alım/satım işlemlerini çok daha profesyonel bir şekilde gerçekleştirebilecek, oluşturacakları çeşitli finansal yatırım stratejileri vasıtasıyla kişisel risk-getiri beklentileri doğrultusunda çok daha bilinçli bir yatırım portföyü yönetim imkanına kavuşmuş olacaklardır.

Kimler Katılnmalı

Sabit getirili tahvil piyasasında yer alan tüm finansal ürünlere yönelik bireysel veya kurumsal olarak yatırım yapan/yapmayı düşünen ya da yatırımlarına yön veren herkesin katılmasını tavsiye ediyoruz.

Eğitim Programı

- Finansal Matematik (Faiz, Getiri Hesaplamaları, Anuite, Faiz-Risk İlişkisi)
- Türkiye'de Borçlanma Araçları Piyasası
- Bono/Tahvil Temel Kavramları
- Tahvil Riskleri ve Risk Primi Ölçümü
- Tahvil, FRN, ÖST, TÜFEX, Geri Çağırılabilir Tahvil..vs Değerlemesi, Analizi
- Forward Faiz Hesaplaması
- Tahvil Fiyat, Getiri Analizleri, Volatilite Değişimi
- Tahvillerde Süre, Konveksite Ölçümleri (Efektif Konveksite, Spread Durasyon)
- Bonolarda Fiyat Risk Ölçümü
- Vade Yapısı Analizi ve Verim Eğrisi Modellemeleri (Bootstrapping, Enterpolasyon, OLS, Spline, Vasicek, CIR)
- Verim Eğrisi Stratejileri
- Tahvil Yatırım Stratejileri (Aktif/Pasif Tahvil Portföy Yönetimi)