

TKBB HAZİNE VE RİSK YÖNETİMİ UZMANLIK SERTİFİKASYON EĞİTİMİ-2

25 EYLÜL - 13 KASIM 2021



DOÇ.DR. İBRAHİM ÜNALI



ARZU ODABAŞI



HÜSEYİN YENER



TARIK BÖREKÇİ



SAİM ÇELİK



DR. VEDAT GÜVEN

- ❖ Modül 1 : Ekonomik Göstergeler ve Finansal Piyasaların Analizi
- ❖ Modül 2 : Finansal Piyasalar ve Bankalarda Hazine Yönetimi
- ❖ Modül 3 : Katılım Bankalarında Hazine Ürünleri ve Sermaye Piyasası Uygulamaları
- ❖ Modül 4 : Hazine ve Aktif ve Pasif Yönetimi – Simülasyonlu
- ❖ Modül 5 : Risk Yönetimi ve Basel II – III
- ❖ Modül 6 : Finansal Türevler ve Risk Yönetimi
- ❖ Modül 7 : Teknik Analiz Uygulamaları
- ❖ SINAV : Albaraka Türk Konferans Salonunda sınav gerçekleştirilecektir.

- ❖ 7 MODÜL
- ❖ 13 GÜN
- ❖ 52 SAAT
- ❖ **ONLINE EĞİTİM**



İLETİŞİM :
TKBB Eğitim Birimi

MODÜL	Eğitim Adı	Gün	Saat	Eğitmen	Eğitim Tarihi	Eğitim Saati
MODÜL – 1	Ekonomik Göstergeler ve Finansal Piyasaların Analizi	1	4	Doç. Dr. İbrahim Ünalmış	25 Eylül 2021 Cumartesi	10:00 – 15:00
MODÜL – 2	Finansal Piyasalar ve Bankalarda Hazine Yönetimi	2	8	Hüseyin Yener	1 - 2 Ekim 2021 Cuma-Cumartesi	10:00 – 15:00
MODÜL – 3	Katılım Bankalarında Hazine Ürünleri ve Sermaye Piyasası Uygulamaları	1	4	Tarık Börekçi	09 Ekim 2021 Cumartesi	10:00 – 15:00
MODÜL – 4	Hazine ve Aktif ve Pasif Yönetimi – Simülasyonlu	4	16	Saim Çelik	15-16 Ekim 2021 Cuma-Cumartesi 22 - 23 Ekim 2021 Cuma-Cumartesi	10:00 – 15:00
MODÜL – 5	Risk Yönetimi ve Basel II – III	1	4	Dr. Vedat Güven	28 Ekim 2021 Perşembe	10:00 – 15:00
MODÜL – 6	Finansal Türevler ve Risk Yönetimi	2	8	Dr. Vedat Güven	5 - 6 Kasım 2021 Cuma-Cumartesi	10:00 – 15:00
MODÜL – 7	Teknik Analiz Uygulamaları	2	8	Arzu Odabaşı	12 - 13 Kasım 2021 Cuma-Cumartesi	10:00 – 15:00
	SINAV, Albaraka Türk Konferans Salonunda Gerçekleştirilecektir.	2 saat		Sınav Heyeti	20 Kasım 2021	10:00 – 12:00
	TOPLAM	13 Gün	52 saat			

TKBB – HAZİNE VE RİSK YÖNETİMİ GELİŞİM YOLCULUĞU



PROGRAMIN AMACI

TKBB olarak, hali hazırda Katılım Bankacılığında çalışan seçilmiş adayları, Hazine ve Risk Yönetimi uzmanlığına hazırlıyoruz.

Bu yolculuk sonunda katılımcılar, banka finansal tabloları ışığı altında, Aktif ve Pasif komitelerinin piyasalarda yaşanmış ve yaşanabilecek gelişmeler üzerine banka bilançosunu nasıl yönlendirebileceklerini, bu süreçte Hazine Yönetimi'nin önemini ve Hazine'nin görevlerini, Hazine Ürünlerini ve fiyatlama sürecini, Risk Yönetimi nosyonunu ve Risk Yönetimi Ürünlerinin yanında, Katılım Bankacılığına özel Hazine Ürünleri'ne hakim olacaklardır.

KİMLER KATILABİLİR?

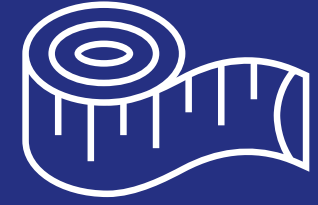
Katılım Bankalarının; Hazine ürünlerinin fiyatlanması ve analizi için hizmet veren Hazine Birimi çalışanları, Türev Masası, Ekonomik Araştırmalar ve Risk Yönetimi Bölümü, Hazine Ürünlerinin Risklerini Ölçen ve Denetleyen Risk Yönetimi, Hazine Operasyon Birimleri ve konuyu derinlemesine öğrenmek isteyen çalışanları katılabilir.

PROGRAM YAKLAŞIMIMIZ



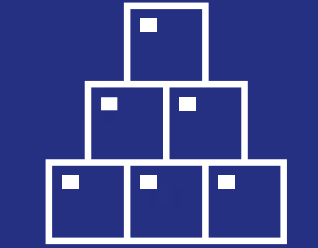
Program Koordinatörleri:

Her programın bir program koordinatörü olacaktır. Görevi:
Eğitmenleri belirlemek
İçeriklerin entegrasyonu
Planlama
Sınav ve sertifika süreçleri
Gerekli iyileştirmelerin ve katılımcı isteklerinin takibi



Sınav ve Sertifika Hakkı

Sertifikasyon Programı (online) tamamlandıktan sonra bu defa, sosyal mesafe gözetilerek yüz yüze sınav yapılacaktır. Bahsi geçen sınav, Albaraka Türk konferans salonunda gerçekleştirilecektir. Sınav sonunda en az **100 üzerinden 70 puan** alan katılımcılar başarılı sayılacaktır. Başarılı katılımcılarımıza «**Başarı Sertifikası**» verilecektir. Programdaki eğitimlere devam zorunluluğu, toplam ders saatlerinin en **az %80'ine katılım zorunlu olacaktır.** Sınav veya devamsızlık kriterlerine uymayanlara sadece katılım belgesi verilecektir.

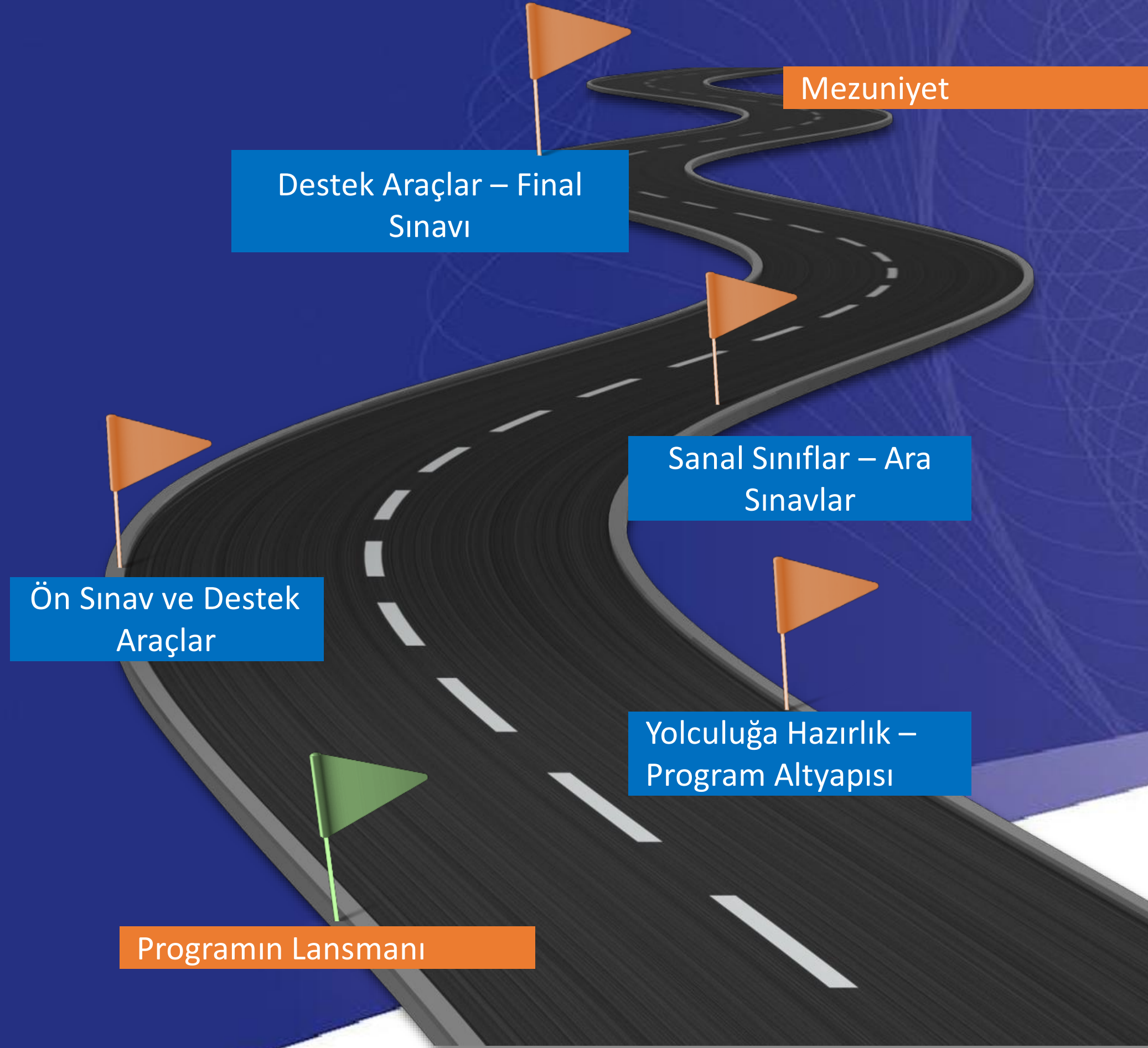


Program Yapısı

Eğitimler TKBB sanal sınıf platformundan verilecektir. Programın açılışını program koordinatörü yapacak, katılımcıların varsa soruları yanıtlanacaktır. Konusuna göre, eğitimlerden önce katılımcılara online okuma dokümanı ya da ön ödev gibi pekiştirici araçlar sunulacaktır.

NOT : SINAVDA SORUMLU OLUNACAK TÜM KONULAR KİTAPÇIK HALİNDE DÜZENLENECEK VE EĞİTİM ÖNCESİNDE DAĞITIMI SAĞLANACAKTIR.

HAZİNE VE RİSK YÖNETİMİ GELİŞİM YOLCULUĞU



UYGULAMALAR

Google Classroom

Eğitmen Tanıtım Videoları

Okuma Dokümanları

Kitap, Fim ve Blog Önerileri

Sınavlar – Soru Bankası

Proje Ödevi

EĐİTİM İÇERİKLERİ

EKONOMİK GÖSTERGELER VE FİNANSAL PİYASALARIN ANALİZİ

Amaç

Bu eğitimde, katılımcıların ekonomi ve piyasalara ilişkin karşılaştığı makro verileri, piyasa göstergelerini, istatistikleri ve makaleleri analiz edip yorumlayabilmesini ve kendi bakış açısını oluşturmasını sağlamak amaçlanmaktadır. İçeriğinde Türkiye, dünya ekonomisi ve küresel finans piyasalarındaki son gelişmeler ve dönüşümler de tartışılmaktadır.

İçerik

- Dünya Ticaretinin Büyüklüğü ve 2050 Trendleri
- Bir Ülkenin Ekonomisini Anlamakta Kullanılan İlk 5 ve İlk 10 Kriter
- Globalleşme, Korumacılık, Tarifeler ve Ticaret Savaşları
- Sermaye Hareketleri ve Kur Rejimleri
- Ekonomik Faaliyetlerin Ölçülmesi, Endeksler ve Borsalar
 - PMI (Satın Alma Endeksi)
 - Güven Endeksleri
 - Üretim ve Tüketim Endeksleri
- Temel Piyasa Göstergeleri
 - Sektör ve Firma Analizleri
 - Makro Ekonomik Analiz
 - Önemli Makro Ekonomik Göstergeler
- Verilerin Piyasalar Üzerine Yansımaları
- Gelecek Beklentileri



25 Eylül 2021
Cumartesi

10:00-15:00

EĞİTMEN



Doç. Dr. İbrahim Ünalımsı

FİNANSAL PİYASALAR VE BANKALARDA HAZİNE YÖNETİMİ

Amaç

Katılımcıların, Aktif ve Pasif Yönetimi ilkeleri çerçevesinde ve APKO kararları ışığında, banka bilançosu yönetimi, Hazine Bölümü'nün iç yapılanması, alt birimlerin sorumlulukları ve şube ilişkileri, döviz ve para piyasalarının terminolojisi, yurtiçi ve yurtdışı döviz ve para piyasalarının işleyişi, pozisyon, vade ve risk nosyonu gibi temel piyasa ve hazine jargonu hakkında bilgilendirilmesi ve çeşitli uygulamalar ile öğrendiklerinin pekiştirilmesi hedeflenmektedir.

İçerik

- Hazine ve Piyasalara İlişkin Genel Tanımlar
 - Piyasa Çeşitleri – Türkiye ve Dünyada İşlem Yapılan Piyasalara Örnekler
 - Pozisyon Alma Kavramı
 - Kullanılan Sistem ve Ekranlar
 - Hedging – Spekülasyon Kavramları
 - Limitler
- Hazine Bölümü Yapılanması (Ön Ofis)
- Hazine – Büyük Resim
- Hazine'nin Bankanın Diğer Bölümleri ile İlişkileri
- Hazine ve Şube İlişkileri



01-02 Ekim 2021
Cuma - Cumartesi

10:00-15:00

EĞİTMEN



Hüseyin YENER

KATILIM BANKALARINDA HAZİNE ÜRÜNLERİ VE SERMAYE PİYASASI UYGULAMALARI

Amaç

Katılım bankaları hazine birimlerinin yürütmüş olduğu para piyasası ile döviz ve kıymetli maden piyasası işlemleri teorik ve pratik şekilde anlatılacak, katılım bankalarının nakitlerini değerlendirme yöntemleri, kira sertifikaları ile döviz alım-satım işlemleri ve kıymetli madenler özelinde –altın- detaylı olarak ele alınacaktır.

İçerik

•Katılım Bankacılığı'nda Para ve Sermaye Piyasası Ürünleri

- Commodity Murabaha İşlemleri
- Sukuk-Kira Sertifikaları
- Dünya'da ve Türkiye'de Sukuk Piyasası
- Sukuk İhraç Türleri
- Sukuklarda Fiyatlama ve İkincil Piyasa İşlemleri
- Yatırım Fonları

•Katılım Bankacılığı'nda Döviz ve Kıymetli Maden İşlemleri

- Spot İşlemler
- Vadeli İşlemler
- Swap İşlemleri
- Opsiyonlar



09 Ekim 2021
Cumartesi

10:00-15:00

EĞİTMEN



Tarık BÖREKÇİ
Vakıf Katılım Bankası
Hazine Müdürü

HAZİNE - AKTİF ve PASİF YÖNETİMİ / SİMÜLASYON

Amaç

Katılımcılara, finansal tablolarda yer alan kavramlar ve bu kavramların birbirleri arasındaki ilişkileri konusunda bilgi vermek amaçlanmaktadır. Bu tablolar üzerinden bankanın aktif ve pasif yönetimi komitesinin mevcut durumun analizi ve gelecek beklentileri çerçevesinde karar alma ve bu kararların uygulanma süreci aktarılacaktır. Özellikle finansal tabloların taşıdığı riskler ve bu risklere ilişkin yönetim stratejileri üzerinde durulacaktır.

Ayrıca, simülasyon uygulamasında katılımcılar, piyasa işlemleri yaparak, bu işlemlerin banka bilançosuna etkisini analiz edip, ortaya çıkan riskleri yöneteceklerdir.

İçerik

- Bankacılıkta Aktif ve Pasif Yönetimi Kavramı
- Aktif ve Pasif Komitesinin Yapılanması ve Aldığı Kararlar
- APKO Kararlarının, Banka Hazinesi Tarafından Uygulanması
- Hazine Ürünlerinde Fiyatlama Stratejisinin İrdelenmesi
- Banka Bilanço İçi ve Bilanço Dışı Kalemlerin Değerlendirilmesi
- Bankaların Taşıdığı Riskler Tanımı ve Analizi
- BDDK Risk Sınırlamaları
- Mevcut Risklerin Yönetim Stratejileri



15-16 Ekim 2021
Cuma-Cumartesi
22-23 Ekim 2021
Cuma Cumartesi
10:00-15:00

EĞİTMEN



Saim Çelik

RİSK YÖNETİMİ BASEL II - III

Amaç

Bu eğitimde bilanço risklerini yönetme amacıyla rasyo analizleri, CAMELS yöntemi, sermaye yeterliliği, Basel I, II ve III'ün uygulamaları ve farkları, bankalarda risk organizasyonu, riskleri sayısallaştırma, VaR hesaplamaları, risk mapping, geriye dönük test, stres testleri ve beklenmedik durum planları konuları işlenecektir.

İçerik

- Finansal Risk Yönetimi
 - Kredi Riski, Operasyonel Risk, Piyasa Riski
 - Risk Yönetim Araçları – Gap ve Durasyon Analizleri
- VaR – Value at Risk (RMD – Riske Maruz Değer)
 - RMD (VaR) Tanımı
 - Ölçüm Metodolojileri
 - Risk Matriksleri ve Risk mapping
 - Geriye Dönük Test
 - Stres Testi
 - Beklenmedik Durum Planları (Contingency Plans)
- Basel II ve III
 - Basel II'nin Yapısı
 - Bankalarda Risk Yönetimi Organizasyonu
 - Basel II de Kredi Riski Ölçüm Yöntemleri
 - Basel II de Operasyonel Risk Ölçüm Yöntemleri
 - Basel III (Bankalar ve Şirketler Açısından)



28 Ekim 2021
Perşembe

10:00-15:00

EĞİTMEN



Dr. Vedat GÜVEN

FİNANSAL TÜREVLER VE RİSK YÖNETİMİ

Amaç

Katılımcıların, günümüz bankacılık işlemlerinde sıklıkla karşılaştığımız türev enstrümanların veya türev içeren işlemlerin özelliklerini, kullanılma şeklini ve fiyatlamasını analiz ederek bankaların sunduğu ürünlere hâkim olmak amaçlanmaktadır. Söz konusu bu ürünleri, bankanın maruz kaldığı bilanço risklerin hedge ederken nasıl kullanılacağını öğrenecek, aynı zamanda müşteri ihtiyaçları açısından da değerlendirme imkanı bulacaklardır.

İçerik

- Finansal Türevlerin Fiyatlaması – Taşıma Maliyeti
- Forward İşlemlerin Fiyatlaması ve Hedging Mekanizması
 - Para ve Döviz Piyasası Ürünleri Üzerine Vadeli Fiyatlamalar
 - Forward İşlemlerin Operasyonu, Teminatlandırılması ve Takibi
- Futures İşlemler ve BIST Viop Piyasası,
- IRS ve CCS Swap Anlaşmaları
- Opsiyonlar
 - Opsiyon Kontratlarında Terminoloji
 - Opsiyon Değerlemesi (İçsel ve Tarihsel Değerleme)
 - Opsiyon Getiri Grafikleri
 - DCD İşlemleri ve Fiyatlaması
 - Egzotik Opsiyonlar



5-6 Kasım 2021
Cuma-Cumartesi

10:00-15:00

EĞİTMEN



Dr. Vedat GÜVEN

TEKNİK ANALİZ UYGULAMALARI

Amaç

Katılımcıların geçmiş dönem fiyat hareketlerinin analiz edilerek gelecek dönem tahminlemesine dönük yapılan çalışmaların detaylarını anlaması ve örnek uygulamalar üzerinden deneyimlemesi amaçlanmaktadır.

İçerik

- Teknik Analiz Nedir?
- Yatırım Kararı Verirken Teknik Analiz
- Teknik Analiz Yöntemleri

Uygulama: Örnek grafikler üzerinde çalışma yapılması



12-13 Kasım 2021
Cuma Cumartesi

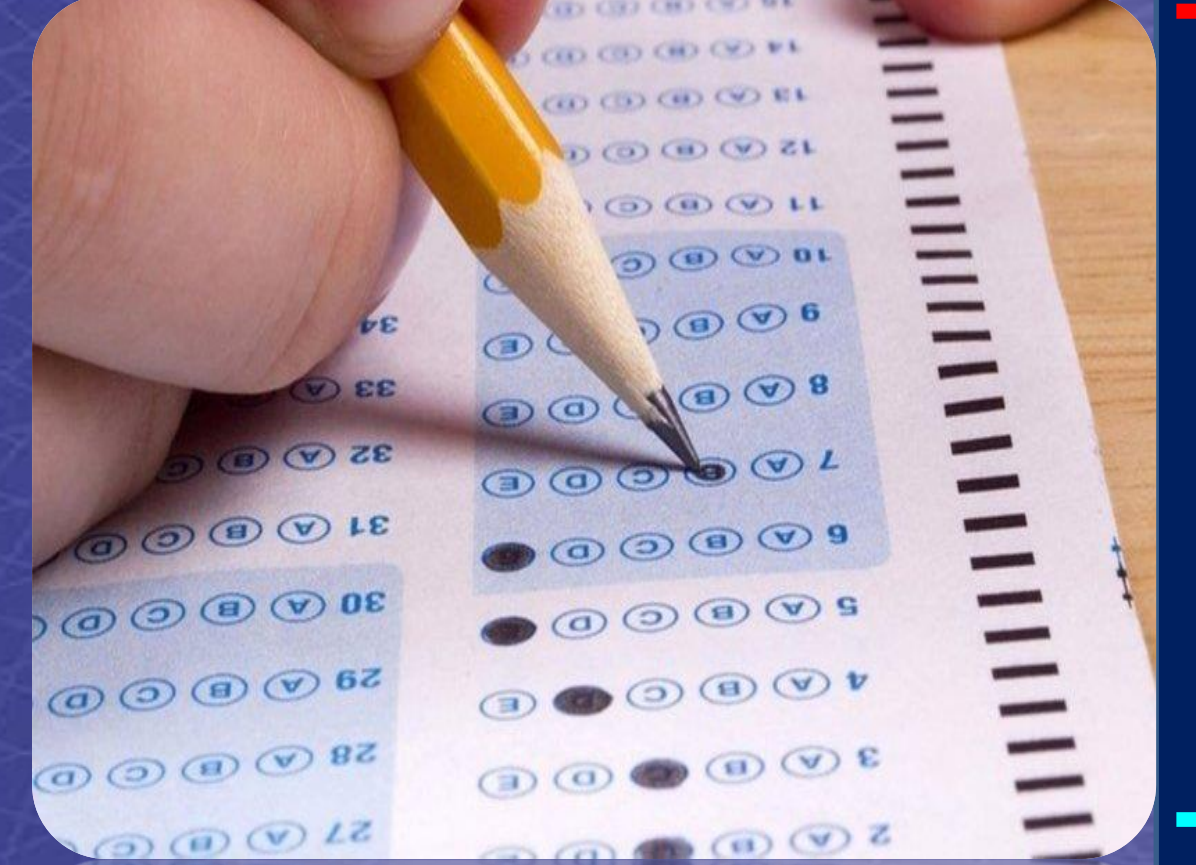
10:00-15:00

EĞİTMEN



Arzu Odabaşı

❖ SINAV



İşin Kapanışı



20 KASIM 2021

Cumartesi

10:00-12:00

EĐİTMEN ZGEÇMİŐLERİ

Do. Dr. İbrahim ÜNALMIŞ



Do. Dr. İbrahim Ünal mıř 2018 yılından günümüze TED Üniversitesi İşletme Bölümü'nde Bölüm Başkanı olarak görev yapmaktadır. TEDUTECH Yönetim Kurulu ve TED Üniversitesi Uygulamalı Veri Bilimi Merkezi Bilim Kurulu üyelikleri devam etmektedir.

Academy of Management ve International Association for Applied Econometrics üyeliklerinin yanı sıra Dünya Bankası'na danışmanlık hizmeti sağlamaktadır.

Lisans derecesini ODTÜ İktisat Bölümü'nden almıştır. Yüksek lisans derecesi Birmingham Üniversitesi'nden Para, Banka ve Finans alanında, doktora derecesi York Üniversitesi'nden Ekonomi alanındadır.

2000-2018 yılları arasında Türkiye Cumhuriyet Merkez Bankası'nda Piyasalar ve Dış İlişkiler Genel Müdürlükleri'nde Müdür, Ekonomist ve Uzman olarak görev yapmıştır.

Doktora sürecinde İngiltere ve İrlanda'da makroekonomi ve finans alanlarında dersler vermiştir.

Hüseyin YENER



Almanya doğumlu olan Hüseyin Yener, lisans eğitimini ODTÜ-İktisat bölümünde tamamlamıştır. Profesyonel çalışma hayatına 1991 yılında TCMB’de Araştırma Asistanı olarak başlamış, daha sonra kariyerine Toprakbank Hazine Bölümü’nde devam etmiştir. Sonraki yıllarda Yapı ve Kredi Bankası, Egebank, Yatırımbank’ta Hazine ve Özel Bankacılık bölümlerinde görev yapmıştır.

Yurtdışında Denizbank Moskova ve Denizbank Viyana’da Genel Müdür Yardımcısı pozisyonlarında çalışmıştır. 2010 yılında Türkiye’ye dönerek Bosphorus Capital Portföy Yönetimi’nin kuruluşunda Kurucu Ortak sıfatıyla yer almıştır. Şirket hisselerinin İtalyan Azimut Grubu’na devri ile, danışman olarak bu şirkete hizmet vermeye devam etmektedir.

1998 yılından bu yana kurum içi ve kurum dışı çok sayıda eğitim programında eğitmen olarak yer almanın yanı sıra, İstanbul Bilgi Üniversitesi’nde bir süre konuk öğretim görevlisi olarak finans dersleri vermiştir. Yener, evli ve bir kız babasıdır. 2015-.... Azimut Portföy Yönetimi Danışman 2010-2015 Bosphorus Capital Portföy Yönetimi Yönetim Kurulu Üyesi 2005-2010 Denizbank AG Genel Müdür Yrd 2004-2005 Denizbank Moscow Genel Müdür Yrd 2002-2004 Yatırımbank Hazine Pazarlama Mdr 1998-2001 Egebank Hazine Pazarlama Mdr 1995-1997 Yapı ve kredi Bankası FX Dealer 1993-1995 Toprakbank FX Dealer 1991-1992 Türkiye Cumhuriyet Merkez Bankası Araştırma Asistanı

SAİM ÇELİK



1970 İstanbul doğdu. 1991 yılında İstanbul Üniversitesi İşletme Fakültesinde Lisans öğrenimini tamamladı. İMKB’de broker olma sevdasıyla çıktığı kariyer yolculuğunda kendisini Hazineci olarak buldu. Sırasıyla Derbank, Toprakbank, Sınai Yatırım Bankası ve Türkiye Sınai Kalkınma Bankalarında çeşitli kademelerde çalışma ve yöneticilik yaptı. 1996 yılında Toprakbank’ta iç eğitimci olarak başlayan eğitici olma sevdası halen sürmektedir.

Özellikle Aktif Pasif Yönetimi, Türev Ürünler, Hazine Yönetimi vb. benzer konularda, Türkiye ve yurtdışında, banka ve reel sektör şirketlerine çok sayıda eğitim verdi.

Tim Danışmanlık bünyesinde kullanılan “Hazine Yönetimi Simülasyonu” ve “VIOP Simülasyonu” ürünlerini geliştirdi.

Halen, Tim Danışmanlık bünyesindeki eğitim ve danışmanlık faaliyetlerinin yanı sıra, Türkiye Bankalar Birliği, muhtelif üniversitelerde ve sivil toplum kuruluşlarında eğitimci ve konuşmacı olarak çalışmalarına devam etmektedir.

Tarık BÖREKÇİ



2016 yılından bu yana Vakıf Katılım Bankası'nda Hazine Birim Müdürü olarak görev yapmaktadır.

2006-2016 yılları arasında Türkiye Finans Katılım Bankası'nda aşağıdaki görevlerde bulunmuştur.

Hazine Front OfficeHazine Middle OfficeBahreyn Şube2004-2006 yılları arasında Kuveyt Türk Katılım Bankası'nda Hazine Operasyon Birimi'nde çalışmıştır.

2015 yılında Sabancı Üniversitesi'nde Executive MBA Yüksek Lisans Programını tamamlamıştır.

2003 yılında Marmara Üniversitesi İngilizce İktisat Bölümü'nden mezun olmuştur.

Dr. Vedat GÜVEN



İstanbul Atatürk Fen Lisesi'nin ilk mezunlarından olan Vedat Güven, Boğaziçi Üniversitesi'nde Elektrik-Elektronik Mühendisliği ve Ekonomi Yüksek Lisansı ardından da Marmara Üniversitesi'nde Bankacılık Doktorası yaptı. Mesleki kariyerine Garanti Bankası'nda Hazineci olarak başlayıp 1999 yılında Tim'i kurana kadar Tütünbank, Bank Ekspres ve Toprakbank'ta Hazine Departmanı'nın her yerinde tecrübe edinmiş oldu.

1999 yılından beri Tim'de yöneticilik, eğitmenlik ve danışmanlık yapmakla beraber TBB'de, İstanbul Ünv'de, Bilgi Ünv'de, Yeditepe Ünv'de ve Bahçeşehir Ünv'de dönem dönem öğretim görevlisi olarak da görev almıştır.

TBB tarafından basılan “TRL Bacaklı Futures Kontratları” isimli bir kitapçık ile “Blokzincir: Satoshi Dünyayı Değiştiriyor” isimli yayımlanmış iki kitabı vardır. 1999 –

Tim Danışmanlık / Kurucu Ortak 1994 – 1998 Toprakbank / Hazine Müdürü 1992 – 1994 BankEkspres / Hazine Müdürü 1991 – 1992 Tütünbank / İl. Müdür 1989 – 1991 Garanti Bankası / Uzman

Arzu Odabaşı



1990 yılında İstanbul Üniversitesi İşletme fakültesinden mezun olmuş, aynı fakültede işletme finansmanı master programını tamamlamıştır. Türkiye de Teknik Analiz'in etkin kullanılmasına olumlu yönde katkıları olan Arzu Odabaşı, Finans Yatırım Araştırma departmanında Hisse senedi/ Sektör Analisti ve Teknik Analist olarak 11 yıl çalışmıştır.

2002 ekonomik kriz döneminde, Finans Yatırım bursu ile Londra City Cass İşletme Fakültesinde, Yatırım Yönetimi Master programından mezun olan Arzu Odabaşı, pek çok yerli ve yabancı yatırımcıya yatırım yönetim tavsiyesi veren, sektör ve hisse senedi temel analiz raporları hazırlamıştır. Arzu Odabaşı, 2005 yılında Global Menkul Değerlere Hisse Senedi Yatırım Stratejist'i olarak transfer olmuştur. Ardından, profesyonel hayatına, Eczacıbaşı Menkul Değerler'de Varlık Yönetim bölümü kurarak devam eden Arzu Odabaşı, sonrasında QNB Finans Portföy ve Türkiye Varlık Fonunda çalışmıştır.

İki dönem üst üste Sabancı Üniversitesi, Finans Cafe Master öğrencilerine, Teknik analiz uygulamaları konulu ders vermiştir. 1998 yılından itibaren düzenli olarak, CNBC-e, NTV, Bloomberg gibi Ekonomi kanallarında, Yatırım Yönetimi alanında yorum ve değerlendirmelerde bulunan Arzu Odabaşı, Kadın, Çocuk, İnovasyon bazlı gönüllülük esaslı projelerde önemli katkılar sağlamıştır.



**TÜRKİYE
KATILIM
BANKALARI
BİRLİĞİ**