

HAZİNE VE RİSK YÖNETİMİ UZMANLIK SERTİFİKASYON EĞİTİMİ

**TKBB - HAZİNE VE RİSK YÖNETİMİ
UZMANLIK SERTİFİKASYON EĞİTİMİ - IV**

HAZİNE VE RİSK YÖNETİMİ UZMANLIK SERTİFİKASYON EĞİTİMİ - IV

MODÜL	EĞİTİM KONUSU	EĞİTMEN	TARİH	SAAT
MODÜL-1	Ekonomik Göstergeler ve Finansal Piyasaların Analizi	Dr. Fulya Gürbüz	22 Eylül 2023	10:00 - 16:00
MODÜL-2	Bankalarda Hazine Yönetimi ve Aktif ve Pasif Simülasyonu	Saim Çelik	29-30 Eylül 2023 13-14 Ekim 2023	10:00 - 16:00
MODÜL-3	Finansal Türevler ve Risk Yönetimi	Dr. Vedat Güven	20-21 Ekim 2023	10:00 - 16:00
MODÜL-4	Risk Yönetimi ve Basel II - III	Dr. Vedat Güven	27 Ekim 2023	10:00 - 16:00
MODÜL-5	Katılım Bankalarında Hazine Ürünleri ve Sermaye Piyasası Uygulamaları	Tarık Börekçi	28 Ekim 2023	10:00 - 16:00
MODÜL-6	Teknik Analiz Uygulamaları	Umut Gümülcineli	03-04 Kasım 2023	10:00 - 16:00

SERTİFİKA PROGRAMININ 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.

HEDEF KİTLE:

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.

SERTİFİKA PROGRAMI FORMATI:

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. Sertifikasyon Programı (online) tamamlandıktan sonra bu defa, TKBB LMS platformunda online sınav yapılacaktır. 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.

UYGULAMALAR:

- Google Classroom
- Eğitimci Tanıtım Videoları
- Okuma Dökümanları
- Kitap, Film ve Blog Önerileri
- Sınavlar ve Soru Bankası
- Proje Ödevi



6
MODÜL



11
GÜN



50
SAAT



ÇEVİRİMİÇİ EĞİTİM
MICROSOFT TEAMS



ONLİNE SINAV
20 KASIM 2023
10:00-12:00
TKBB LMS



22 Eylül 2023
10.00 - 16.00

MODÜL 01:

Ekonomik Göstergeler ve Finansal Piyasaların Analizi

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.

İÇERİK:

- 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

Eğitiminin Özgeçmişi



Dr. Fulya GÜRBÜZ

Malatya 1971 doğumlu, iki çocuk annesi. Boğaziçi Üniversitesi Matematik lisans ve Finans Mühendisliği yüksek lisans, Marmara Üniversitesi Bankacılık doktora programı mezunu. Makro-ekonomik analizler yapmakta, finans teorisi ve uygulamaları konularında akademik dersler vermiş, sabit getirili menkul kıymetlerle ilgili olarak çeşitli banka ve aracı kurumlarda çalışmıştır.

Profesyonel çalışma hayatına 1994 yılında İş Bankası Menkul Kıymetler Müdürlüğü'nde sabit getirili menkul kıymetlerin alınıp satılması, analiz ve raporlar hazırlanması konularında çalışmış, iş tanımını 1996-1997 döneminde Eczacıbaşı Menkul Değerlerde ve 1997-1999 döneminde Yatırım Finansman Menkul Değerlerde sürdürmüştür. 1999-2004'te İktisat Yatırım Menkul Değerlerde sabit getirili menkul kıymetlerle ilgili analizler ve periyodik raporlar hazırlamıştır. 2004 yılında doktora programına kabul edilmesiyle finans sektöründen ayrılmıştır. Ekim-Aralık 2007'de Turkcell Hazine Bölümü tarafından kullanılan bilgi işlem altyapısının yenilenmesi projesinde Turkcell ve yazılım firması Coretech arasında köprü görevi üstlenmiştir.

2006-2014 döneminde çeşitli üniversitelerde finans matematiği, sigorta matematiği, ekonometriye giriş, olasılık, türev ürün fiyatlama ve menkul değerler, finans teorisi dersleri vermiştir. 2008-2018 döneminde kurucu ortak ve editör olarak finanstrend.com sitesinde makro-ekonomik analizlerini yayınlamaya başlamış, editörlerini ekonomi ve finansal okuryazarlık konularında eğitmiştir. 2008'den bu yana şirketlere haftalık ve aylık makro-ekonomik raporlar hazırlamakta, 2018'den beri analizlerini fulyagurbuz.com bloğunda paylaşmakta, 2019'dan beri ekonomi okuryazarlığını yaygınlaştırmak amacıyla eğitimler vermekte, 2020'den bu yana paraanaliz.com'da köşe yazarı olarak analizlerini yayınlamaktadır.

Rasyonel karar almada finansal okuryazarlığın ekonomi okuryazarlığıyla desteklenmesi gerektiğini savunmaktadır.



29-30 Eylül 2023
13-14 Ekim 2023
10.00 - 16.00

MODÜL 02:

Bankalarda Hazine Yönetimi ve Aktif Pasif Simülasyonu

AMAÇ:

Katılımcılara, finansal tablolarda yer alan kavramlar ve bu kavramların birbirleri arasındaki ilişkileri konusunda bilgi vermek amaçlanmaktadır. Bu tablolar üzerinden bankanın aktif ve pasif yönetim 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.

İÇERİK:

- 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

Eğitimcinin Özgeçmişi



Saim 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 eğitimci 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 “VİOP 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.



20-21 Ekim 2023
10.00 - 16.00

MODÜL 03: Finansal Türevler ve Risk Yönetimi

AMAÇ:

Katılımcıların, günümüz bankacılık işlemlerinde sıklıkla karşılaştığımız türev enstrümanların veya türev içeren işlemlerin özelliklerini, kullanıma 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.

İÇERİK:

- 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

Eğitimcinin Özgeçmişi



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 Üniv'de, Bilgi Üniv'de, Yeditepe Üniv'de ve Bahçeşehir Üniv'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 / II. Müdür 1989 - 1991 Garanti Bankası / Uzman



27 Ekim 2023
10.00 - 16.00

MODÜL 04: Risk Yönetimi ve 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.

İÇERİK:

- 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 Matrisleri 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)

Eğitimcinin Özgeçmişi



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 Ün'v'de, Bilgi Ün'v'de, Yeditepe Ün'v'de ve Bahçeşehir Ün'v'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

MODÜL 05:

Katılım Bankalarında Hazine Ürünleri ve Sermaye Piyasası Uygulamaları



28 Ekim 2023
10.00 - 16.00

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.

İÇERİK:

- 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

Eğitimcinin Özgeçmişi



Tarık BÖREKÇİ

2021 yılından bu yana, Eksim Yatırım Holding bünyesinden Hazine Direktörü olarak görevine devam etmektedir.

2016-2021 yılları arasında Vakıf Katılım Bankası'nda Hazine Birim Müdürü olarak görev yapmıştır.

2006-2016 yılları arasında Türkiye Finans Katılım Bankası'nda çalışmaya hayatına devam etmiştir.

Hazine Front Office Hazine Middle Office Bahreyn 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.



03-04 Kasım 2023
10.00 - 16.00

MODÜL 06: Teknik Analiz Uygulamaları

AMAÇ:

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

İÇERİK:

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

Uygulama: Örnek grafikler üzerinde çalışma yapılması

Eğitimcinin Özgeçmişi



Umut GÜMÜLCİNELİ

Edirne doğumlu olan Umut Gümülcineli, lisans eğitimini Dokuz Eylül Üniversitesi İİBF Ekonometri bölümünde tamamlamıştır.

Profesyonel çalışma hayatına 2006 yılında Matriks Bilgi Dağıtım'da eğitmen olarak başlamıştır. Yatırım Finansman Menkul Değerler'de Fon ve Portfoy Müdürlüğü yapmıştır.

Turkcell Hazine'ye eğitim ve danışmanlık hizmeti vermiştir. İstanbul Üniversitesi ve Kadir Has Üniversitesi'nde öğretim görevlisi olarak devam etmektedir.

2010 yılından beri Tim Danışmanlık'ta eğitmenlik yapmaktadır. 2016 yılından itibaren Meksa Yatırım'da yöneticilik yapmaktadır.

SERTİFİKASYON PROGRAMIYLA İLGİLİ BAZI ESASLAR

- ❖ Sertifikasyon eğitimi “TKBB Sertifikasyon Yönergesi” kapsamında sürdürülecektir.
- ❖ Sertifikasyon Programı 5 hafta, 11 Gün, 6 Modül, 50 Saatte tamamlanacaktır.
- ❖ Eğitim programı süresince 5 farklı Eğitimci ders verecektir.
- ❖ Bu program merkezi denetim esas alınarak geliştirilmiştir. İlave olarak her bir işlemin şubelerde nasıl denetleneceği ile ilgili ayrı bir çalışma yapılabilir.
- ❖ Eğitim kadrosu; akademisyen ve katılım bankaları mensuplarından oluşmaktadır.
- ❖ Eğitim; BDDK, Katılım Bankaları, Eximbank, Kalkınma ve Yatırım Bankaları ile Akredite edilen firma temsilcilerine yönelik düzenlenmiştir.
- ❖ Eğitim programı sonunda çoktan seçmeli (4 seçenek) ve toplam 50 sorudan oluşan online sınav yapılacaktır. Sınav, TKBB LMS Platformu üzerinde her bir katılımcı için oluşturulacak kullanılarak gerçekleştirilecek.
- ❖ Sınav sonucunda 100 puan üzerinden, 70 puan ve üzeri alan katılımcılarımıza dijital “Başarı Sertifikası” verilecektir.

TKBB HAZİNE VE RİSK YÖNETİMİ UZMANLIK SERTİFİKASYON EĞİTİMİ - IV

www.tkbbegitim.org.tr