

Ankara Üniversitesi
Kütüphane ve Dokümantasyon Daire Başkanlığı
Açık Ders Malzemeleri

Ders izlence Formu

Dersin Kodu ve İsmi	GGY468 Menkul Kıymetleştirme
Dersin Sorumlusu	Öğretim Görevlisi Hüseyin YURDAKUL
Dersin Düzeyi	Lisans
Dersin Kredisi	3,0
Dersin Türü	Seçmeli
Dersin İçeriği	Menkul kıymetleştirme tanımı, tahviller, ipotekler, konut finansmanı kavramı
Dersin Amacı	Yapılandırılmış finans ve sabit getirili menkul kıymetlerin temelleri, menkul kıymetleştirmenin temel ekonomik unsurları, menkul kıymetleştirme süreci: varlık havuzlarının oluşturulması, dilimlenmesi ve iyileştirilmesi, menkul kıymetleştirilmiş finansal araçların (özellikle ipoteğe dayalı menkul kıymetler) yapıları ve analizi, ipoteğe dayalı menkul kıymetlerin değerlendirilmesi ve nakit akımların incelenmesi, fiyatlama teknikleri, Monte Carlo Simülasyonu, opsiyon fiyatlama teknikleri, dayanak varlıkların erken ödeme ve temerrüt risklerinin modellenmesi ve yönetilmesi, büyük veri yönetiminin temelleri, uluslararası menkul kıymetleştirme uygulamaları (iyi uygulamalar), menkul kıymetleştirmenin mevzuat yönü, menkulleştirilmiş tahvil piyasalarının yapısı, işlemlerin anlaşılması ve küresel piyasada mevcut durum, menkulleştirilmiş finansal araçların alım satımı, derecelendirilmesi ve stres testlerinin anlaşılması, varlığa dayalı menkul kıymetlerin (VDMK) proje finansmanında kullanılması, başlıca ülkelerde menkul kıymetleştirme yöntemleri ve kurumsal yapıları: Government National Mortgage Association, Federal Home Loan Mortgage Corporation, Federal National Mortgage Association, Türkiye için durum analizi ve geleceğe yönelik beklentilerin irdelenmesi.
Dersin Süresi	2 + 2
Eğitim Dili	Türkçe
Ön Koşul	Yok
Önerilen Kaynaklar	Gayrimenkul Finansmanı ve Değerlemesi, A. Alp, İstanbul Menkul Kıymetler Borsası Yayınları, İstanbul, Aralık 2002., İpoteğe Dayalı Menkul Kıymetler, ABD ve Türkiye uygulamaları; ABD ve Avrupa Ülkeleri İçin Ekonometrik Bir İlişki Çalışması, S. Bayraktar (Kumbasar), İstanbul Üniversitesi Sosyal Bilimler Enstitüsü, Doktora Tezi, Eylül, 2007., Modern

	Konut Finansmanı, A. Alp, Sermaye Piyasası Kurulu Yayınları, İkinci Baskı, : Ankara 2001.
<i>Dersin Kredisi (AKTS)</i>	3,0
<i>Laboratuvar</i>	-
<i>Diğer-1</i>	-