



BANKALARDA RİSK YÖNETİMİNİN DENETİMİ

Akılcı

Çözümler

Üretiyoruz

Denetim ve İç Kontrol Eğitimleri

RiskActive
Danışmanlık & Eğitim
www.riskactive.com

BANKALARDA RISK YÖNETİMİNİN DENETİMİ

“Sadece geçmişe ve bugüne bakanlar,
geleceği kaçırlar.”
John F. Kennedy



EĞİTİMİN AMACI

Bu eğitim ile katılımcılara risk ölçüm sistemlerinin denetlenmesinde kritik olan temel istatistik kavramları, ekonometrik modeller ve bunların dikkat edilmesi gereken kısımları anlatılmaktadır. Ayrıca piyasa riski, kredi riski, operasyonel risk ölçümü, kullanılan veri kalitesinin, modellerin ve sistemlerin denetimi ile ilgili pratik ve özet bilgiler aktarılmaktadır. İçsel ve dışsal modellerin yapısı, denetim gözetim otoritesine yapılan raporlamaların temel özelliklerinin incelenmesi detaylı anlatılmaktadır. Prosedür ve politikaların incelenmesi, yönetmeliklerin ve basel kriterlerine uyumun incelenmesi detaylı anlatılmaktadır.

KİMLER KATILMALI

Risk Yönetimi bölümlerinin denetimine katılacak veya denetim biriminde bu denetimleri kontrol edecek personel katılmalıdır.

EĞİTİMİN İÇERİĞİ

1. Temel İstatistiksel ve Ekonometrik Kavramlar

- ✓ Zaman Serileri Ve Getiri Değişimi ve Uygulama alanları
- ✓ Tanımlayıcı İstatistikler (Descriptive Statistics)
- ✓ Volatilite Modelleri
- ✓ Olasılık Dağılımları ve Uygulamalar
- ✓ Verim Eğrisi Modelleri ve Faiz Hesaplamaları
- ✓ Stokastik Simulasyon Modelleri ve Kullanımı
- ✓ Monte Carlo Simulasyonu ve Kullanımı

2. Piyasa Riskine İlişkin Yapılacak Denetimin Temel Adımları

- ✓ Denetim Planının Belirlenmesi ve Denetim Adımlarının Planlanması
- ✓ Süreç, Yönetmeliklerin ve Prosedürlerin Denetimi
- ✓ Basel Düzenlemelerine Uyumun Denetlenmesi
- ✓ Standart Yöntem ve Diğer Yasal Raporların İncelenmesi
- ✓ Kullanılan Verinin Kaynağı, Kalitesi ve Doğruluğunun Denetimi
- ✓ Kullanılan İstatistiksel Modellerin Denetimi
- ✓ Kullanılan Verim Eğrisi Modellerin Denetimi
- ✓ Kullanılan Volatilite Modellerinin Denetimi
- ✓ Olasılık Dağılımlarının Denetimi
- ✓ VaR Modellerine İlişkin Başlangıç Parametrelerinin ve Tanımlamaların Uygunluk Denetimi
- ✓ VaR Modelinin Hesaplama Özellikleri ve Sonuçlarının Denetimi
- ✓ Stres Testi ve Senaryo Analizlerinin Özellikleri ve Denetimleri
- ✓ Recap ve Ecap Modeli Özellikleri ve Denetimi
- ✓ Limit Politikalarının Özellikleri ve Denetimi
- ✓ Raporların Özellikleri ve Denetimi
- ✓ Back Testing Sistemi Özellikleri ve Denetimi





- ✓✓ Piyasa Riskinin Kurumun Sermaye Yeterlilik Rasyosuna Etkilerinin İncelenmesi
- ✓✓ Sermaye Yeterlilik Rasyosu Hesaplanışına İlişkin Denetimler

3. Kredi Riskine İlişkin Yapılacak Denetimin Temel Adımları

- ✓✓ Denetim Planının Belirlenmesi ve Denetim Adımlarının Planlanması
- ✓✓ Süreç, Yönetmeliklerin ve Prosedürlerin Denetimi
- ✓✓ Basel Düzenlemelerine Uyum Hazırlıklarının Denetlenmesi
- ✓✓ Standart Yöntem ve Diğer Yasal Raporların İncelenmesi
- ✓✓ Kullanılan Verinin Kaynağı, Kalitesi ve Doğruluğunun Denetimi
- ✓✓ Kullanılan İstatistiksel Modellerin Denetimi
- ✓✓ İçsel Rating Modeline İlişkin Denetimler
- ✓✓ Kullanılan/Planlanan İçsel Ölçüm Modellerine İlişkin Başlangıç Parametrelerinin ve Tanımlamaların Uygunluk Denetimi
- ✓✓ İçsel Model Hesaplama Özellikleri ve Denetimi
- ✓✓ Limit Politikaları Özellikleri ve Denetimi
- ✓✓ Back Testing Sistemi Özellikleri ve Denetimi
- ✓✓ Risk Bazlı Fiyatlama Yaklaşımının Özellikleri ve Denetimi
- ✓✓ Kredi Riskinin Kurumun Sermaye Yeterlilik Rasyosuna Etkilerinin İncelenmesi
- ✓✓ Sermaye Yeterlilik Rasyosu Hesaplanışına İlişkin Denetimler

4. Operasyonel Riske İlişkin Yapılacak Denetimin Temel Adımları

- ✓✓ Denetim Planının Belirlenmesi ve Denetim Adımlarının Planlanması
- ✓✓ Süreç, Yönetmeliklerin ve Prosedürlerin Denetimi
- ✓✓ Basel Düzenlemelerine Uyum Hazırlıklarının Denetlenmesi
- ✓✓ Standart Yöntem ve Diğer Yasal Raporların İncelenmesi
- ✓✓ Kullanılan Verinin Kaynağı, Kalitesi ve Doğruluğunun Denetimi
- ✓✓ Kullanılan İstatistiksel Modellerin Denetimi
- ✓✓ İçsel Rating Modeline İlişkin Denetimler
- ✓✓ Kullanılan/Planlanan İçsel Ölçüm Modellerine İlişkin Başlangıç Parametrelerinin ve Tanımlamaların Uygunluk Denetimi
- ✓✓ Oprisk İçsel Model Hesaplama Özellikleri ve Denetimi
- ✓✓ Limit Politikaları Özellikleri ve Denetimi
- ✓✓ Back Testing Sistemi Özellikleri ve Denetimi
- ✓✓ Risk Bazlı Fiyatlama Yaklaşımının Özellikleri ve Denetimi
- ✓✓ Basel II' Ye Uygun İçsel Oprisk Veri Tabanı Ve Kayıp Veri Tabanının Özellikleri ve Denetimi
- ✓✓ Operasyonel Risklerin Transferi İçin Kullanılan Sigorta Poliçelerinin Oprisk Veri Tabanına Uyumuna İlişkin Özellikler ve Denetimi
- ✓✓ Operasyonel Risklerin Kurumun Sermaye Yeterlilik Rasyosuna Etkilerinin İncelenmesi
- ✓✓ Sermaye Yeterlilik Rasyosu Hesaplanışına İlişkin Denetimler

5. Sonuç ve Genel Değerlendirmeler

EĞİTİMİN SÜRESİ

2 gün

RiskActive
Danışmanlık & Eğitim
www.riskactive.com

RiskActive,

2003 Yılından beri faaliyetlerine devam eden RiskActive; risk yönetimi, finansal yönetim, alternatif finans uygulamaları ve finans mühendisliği alanlarında hizmet vermektedir. Akademik çevrelerle ve iş dünyası ile işbirliği içinde, dünyada kabul görmüş finansal uygulamaları ve risk yönetim modellerini, Türkiye şartlarına uyumlu hale getiren, uluslararası kriterler ile uyumlu eğitim, danışmanlık ve yazılım hizmetleri sunan, yeni modeller geliştirmeyi ve risk yönetimi anlayışının Türkiye'de benimsenmesine katkıda bulunmayı hedefleyen, öncü bir danışmanlık şirketidir.

Katılımcılar; güncel ve iş hayatında uygulanabilir simülasyonlu eğitimlerimizle, kurumlarında fark ve fayda yaratmayı başarmakta, hem bireysel hem de kurum içi verimliliklerini artırmaktadır.



A: Koşuyolu Mah. İsmail Paşa Sk. No:5 Kadıköy / İSTANBUL



T: 0090 216 327 00 39 - 0090 216 327 00 90 - 0090 216 327 51 27 F: 0090 216 327 51 24



info@riskactive.com