



### AMAÇ

Katılımcılara risk ölçüm sistemlerinin denetlenmesinde kritik olan temel istatistik kavramları, ekonometrik modeller, piyasa riski, kredi riski, operasyonel risk ölçümü, kullanılan veri kalitesinin, modellerin ve sistemlerin denetimi ile ilgili pratik ve özet bilgiler aktarılması amaçlanmaktadır. İçsel ve dışsal modellerin yapısı, denetim gözetim otoritesine yapılan raporlamaların temel özelliklerinin incelenmesi anlatılmaktadır. Prosedür ve politikaların incelenmesi, yönetmeliklerin ve BASEL kriterlerine uyumun denetimi detaylı olarak incelenmektedir.

### ODAK NOKTALARI

#İçsel Risk Hesaplama Modelleri #Denetim #Basel Kriterleri

### EĞİTİMDEN BEKLENEN SONUÇLAR

Bilir: Temel istatistiksel ve ekonometrik kavramları ve risklere ilişkin denetimin temel adımlarını bilir.

Anlar: İçsel risk ölçüm modellerinin hesaplama özelliklerini anlar. Risklere ilişkin yapılacak olan denetimin temel adımlarını anlar. BDDK için hazırlanan raporların temel özelliklerini anlar.

Yapar: Denetimin temel adımları uygular.

### HEDEF KİTLE

Risk Yönetimi bölümlerinin denetimine katılacak veya denetim biriminde bu denetimleri kontrol edecek çalışanların katılımına uygundur.

### NOT

Eğitimin iki günü bilgisayar uygulamalı olarak gerçekleştirilecektir.

- ❑ İstatistiksel ve Ekonometrik Kavramlar
  - ▶ Zaman Serileri ve Getiri Değişimi ve Uygulama Alanları
  - ▶ Tanımlayıcı İstatistikler (Descriptive Statistics)
  - ▶ Volatilité Modelleri, Olasılık Dağılımları ve Uygulamalar
  - ▶ Verim Eğrisi Modelleri ve Faiz Hesaplamaları
  - ▶ Stokastik Simulasyon Modelleri ve Kullanımı
  - ▶ Monte Carlo Simulasyonu ve Kullanımı
- ❑ 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 Volatilité 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
- ❑ 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
- ❑ 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

### EĞİTİM YETKİNLİK İLİŞKİSİ

Davranışsal Yetkinlikler	Mesleki Gelişim, Analitik Düşünme ve Yaratıcılık
Yönetsel Yetkinlikler	
Mesleki/ Bankacılık Teknik Yetkinlikler	İç Sistemler ve Denetim, Global Zeka
Öz-Gelecek Yetkinlikleri	Öğrenme Stratejileri

Uygulama Yeri	Süre	Eğitim Görevlisi
TBB Eğitim Merkezi	3 gün	M. Barış Akçay

Başlangıç Tarihi : 1.4.2020 - Bitiş Tarihi: 3.4.2020

TBB Üyeleri İçin Eğitim Ücreti: ₺ 1.149 - Diğer Kurumlar İçin Eğitim Ücreti: ₺ 1.329

- Fiyatlarımıza KDV Dahildir.