



AMAÇ

Katılımcıların yönetim ilkeleri kapsamında ve yeni finansal mimari çerçevesinde tanımlanan riskleri daha iyi algılayabilmeleri, değişimi okuyabilmeleri, bankalarda verimli ve etkin bir risk yönetim sistemini kuracak bilgileri edinmeleri amaçlanmaktadır.

ODAK NOKTALARI

#Risk Yönetimi #Bankacılık Riskleri #Sermaye Yeterliliği #Basel

EĞİTİMDEN BEKLENEN SONUÇLAR

Bilir:Risk yönetimi ile ilgili ulusal ve uluslararası düzenlemeleri, teorik ve kavramsal çerçeveyi bilir.

Anlar:Risklerin bileşenlerini ve kaynaklarını, risk yönetim sürecini, risk ölçümünün nasıl yapıldığını, risk, sermaye ve getiri ilişkilerini anlar.

Yapar:Riskleri ve risk kaynaklarını etkin bir şekilde tanımlar, risk analiz ve ölçüm sistemlerini/modellerini etkin olarak kullanır, risk ve sermaye analizlerini yapar, risk yönetimi ve sermaye yeterliliği değerlendirme ve raporlama süreçlerinde veya bu süreçlerin kontrol ve denetiminde rol alır.

HEDEF KİTLE

Risk yönetimi, analiz ve denetim ekiplerinde görev alan çalışanların katılımına uygundur.

NOT

- ❑ Kavram, Teknik ve Organizasyon
 - ▶ Risk ve Risk Yönetimi Kavramları
 - ▶ Büyük Sayılar Yasası, Portföy Kuramı, CAPM
 - ▶ COSO/ ERM ve ISO 31000
 - ▶ Basel Bankacılık Denetim Komitesi ve Düzenlemeleri
 - ▶ Yasal ve Ekonomik Sermaye Kavramları
 - ▶ Beklenen ve Beklenmeyen Kayıp Kavramları (EL, UL)
 - ▶ Risk Kapasitesi/ İştahı/ Profili
 - ▶ Risk Ölçümünde Tanımlayıcı İstatistikler
 - ▶ Parametrik Yöntemler ve Simülasyon Teknikleri
 - ▶ Riske Maruz Değer (VaR, Stres VaR)
 - ▶ Beklenen Kuyruk Kaybı (ES/ ETL, Stres ES/ ETL)
 - ▶ Kredi Riskinin Modellenmesi (CVaR, PD, EAD, LGD)
 - ▶ TFRS 9 Beklenen Zarar Modeli
 - ▶ Riske Dayalı Performans ve Fiyatlama
 - ▶ Vadeli Kur ve Oranlar, Durasyon ve Konveksite
 - ▶ Türev Finansal Araçlar ve Menkul Kıymetleştirme
 - ▶ Stres Testleri, Risk Matrisleri
- ❑ Bilanço (A/P) Risklerinin Yönetimi
 - ▶ Likidite, Faiz Oranı ve Kur Risklerinin Kaynakları
 - ▶ Bilanço GAP Analizleri
 - ▶ Likidite Riskine Maruz Değer (LaR) ve Likidite Ayarlı Riske Maruz Değer
 - ▶ Riske Maruz Gelir Analizi (EaR)
 - ▶ Sermayenin Durasyonu
 - ▶ Fon Transfer Fiyatlama Sistemi
 - ▶ Basel 3 Likidite Oranları
 - ▶ BHFOR Standart Oranı
 - ▶ YPNGP/ Özkaynak Standart Oranı
- ❑ Sermaye Yeterliliği Oranları ve Zarar Karşılama Kapasitesi (Basel 1, 2 ve 3)
 - ▶ Çekirdek Sermaye Yeterliliği Oranı
 - ▶ Birinci Kuşak/ Ana Sermaye Yeterliliği Oranı
 - ▶ Sermaye Yeterliliği Standart Oranı (SYSO)
 - ▶ Sermaye Tamponları
 - ▶ Kaldıraç Oranı, TLAC/ MREL
- ❑ SYSO Birinci Yapısal Blok Riskleri
 - ▶ Piyasa Riskine Esas Tutar
 - ▶ Kredi Riskine Esas Tutar
 - ▶ Operasyonel Riske Esas Tutar
- ❑ SYSO İkinci Yapısal Blok Riskleri
 - ▶ Sermaye Yeterliliği Standart Oranı Neden Yetersiz Kalıyor?
 - ▶ İSEDES/ İDES Prenşipleri
 - ▶ İSEDES Riskleri ve Ölçümü
 - ▶ Sermaye Planlaması
- ❑ Basel 4 Düzenlemeleri
 - ▶ Küresel Kriz ve Tepkisel Düzenlemelerde Düzeltme İhtiyacı
 - ▶ Sermaye Yeterliliği Oranını Güvenilir ve Karşılaştırılabilir Kılma İhtiyacı
 - ▶ Faiz Oranı Riski Yönetiminde Yeni Standartlar
 - ▶ Yeni Piyasa Riski Düzenlemesi
 - ▶ Kredi Riski Ölçümünde Yeni Standart Yöntem
 - ▶ Karşı Taraf Kredi Riski Düzenlemeleri
 - ▶ Büyük Kredi Standartları
 - ▶ Operasyonel Risk Ölçümünde Yeni Standart Yaklaşım
 - ▶ İçsel Model Kısıtlamaları ve Taban Uygulamaları

EĞİTİM YETKİNLİK İLİŞKİSİ

Davranışsal Yetkinlikler	Mesleki Gelişim, Proaktif Davranış, Analitik Düşünme, Kurumsal Farkındalık
Yönetimsel Yetkinlikler	Planlama ve Organizasyon, Sonuç Odaklılık, Koordinasyon, Denetim
Mesleki/ Bankacılık Teknik Yetkinlikler	Mevzuat, İç Sistemler ve Denetim, Raporlama ve Sunum, Maliyet, Fiyatlama, Kıyaslama, Global Zeka
Öz-Gelecek Yetkinlikleri	

Uygulama Yeri	Süre	Eğitim Görevlisi
TBB Eğitim Merkezi	2 gün	Mehmet Ayhan Altıntaş

Başlangıç Tarihi : 9.3.2020 - Bitiş Tarihi: 10.3.2020

TBB Üyeleri İçin Eğitim Ücreti: ₺ 700 - Diğer Kurumlar İçin Eğitim Ücreti: ₺ 820

- Fiyatlarımıza KDV Dahildir.