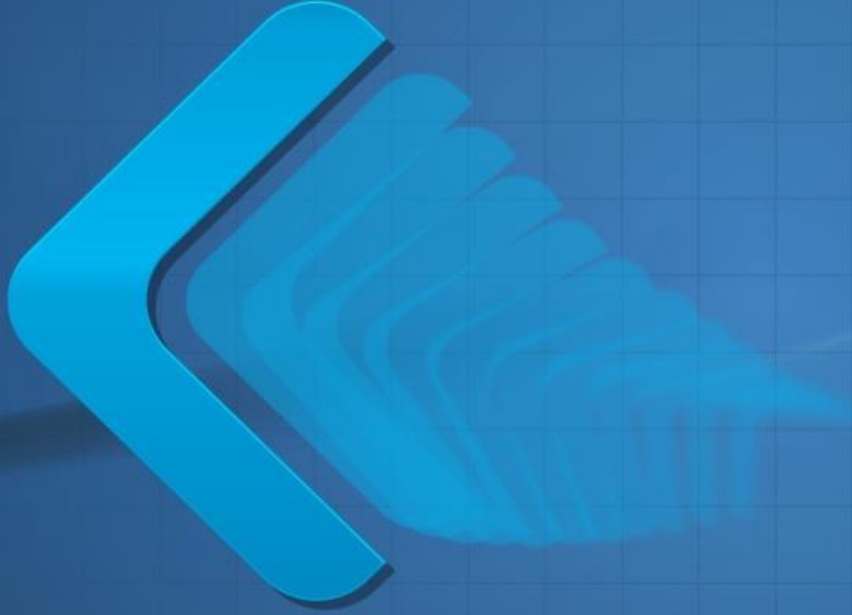


RiskTürk Eđitim Katalođu

**Finansal Risk Yöneticisi
Sertifikası Eđitim Programı
(GARP FRM Exam Level 1)**



RISKTURK
RISK YÖNETİMİ YAZILIM ÇÖZÜMLERİ

Telefon: +90 (212) 965 46 00 / 328 26 87

Faks: +90 (212) 328 26 88

E-Mail: egitim@riskturk.com



EĞİTİM BİLGİLERİ

RISKTURK

Amacı:

- Eğitim programı risk yönetimi alanında global çapta en yaygın sertifika programı olan ve Global Association of Risk Professionals (GARP) tarafından düzenlenen Financial Risk Manager (FRM) sertifika sınavının ilk aşamasına (Level 1) yönelik olarak dizayn edilmiştir.
- FRM sertifika programına ilişkin detaylı bilgiler ilerleyen sayfalarda yer almaktadır.
- Eğitimde FRM sınavı içeriği ile uyumlu olacak şekilde finansal risk yönetiminin felsefesi, risk ölçümü için global çapta kullanılan model ve teknikler, risk yönetiminde iyi uygulama örnekleri, risk yönetimine ilişkin örnek olaylar ve vaka analizleri yer alacaktır. Eğitimde finansal risk yönetimi konusunda kapsamlı bilgi edinmek isteyen katılımcılara finansal risk yönetimi için gerekli olan teknik, yöntem ve bilgileri aktarmak hedeflenmektedir.
- Eğitim programının FRM sertifika sınavına girecek adaylar açısından sınav başarısını önemli ölçüde artırması hedeflenmektedir.

Hedef kitlesi:

- Finansal risk yönetimi alanında çalışan veya çalışmayı planlayan risk yöneticileri,
- Banka, sigortacılık veya yatırım sektöründe çalışan profesyoneller,
- Finansal risklerin yönetilmesi konusunda bilgi birikimini artırmak isteyen reel sektör profesyonelleri

Eğitim Süresi:

- Toplam 10 gündür. 10 hafta boyunca haftasonu günleri tam gün Zoom üzerinden online olarak düzenlenecektir.
- GARP tarafından düzenlenen FRM Level 1 sertifika sınavı bilgisayar üzerinden düzenlenecek olup sınava her yıl Mayıs, Temmuz veya Kasım aylarından birinde girilmesi mümkündür. Sınav tarihinden yaklaşık 2-3 ay önce sınava kayıtlar kapanmakta olup erken kayıtlarda fiyat indirimleri uygulanmaktadır.

Eğitim İçeriği:

- Eğitimde FRM sınavına yönelik olarak konu anlatımlarına, temel konulara ilişkin hatırlatma notlarına, vaka analizlerine, örnek sorulara ve deneme sınavlarına yer verilecektir.
- Eğitim materyalleri ve örnek sorular İngilizce olacak, ancak eğitim dili Türkçe olacaktır.

EĞİTİM İÇERİĞİ

• RİSK YÖNETİMİNİN TEMELLERİ

- Risk türleri, riskin ölçülmesi ve yönetilmesi
- Risk yönetimi ile nasıl değer yaratılır?
- Kurumsal yönetim içerisinde risk yönetiminin rolü
- Kurumsal risk yönetimi
- Önemli finansal çöküşler ve risk yönetimi hataları
- Sermaye varlıkları fiyatları modeli (CAPM)
- Riske göre düzeltilmiş performans ölçümü
- Çok faktörlü piyasa modelleri
- Bilgi riski ve veri kalitesinin yönetilmesi
- Risk yönetiminde etik ilkelerin önemi

• KANTİTATİF ANALİZ

- Kesikli ve sürekli olasılık dağılımları
- Olasılık dağılımlarının parametrelerinin tahmin edilmesi
- Popülasyon ve örneklem istatistikleri
- Bayesci istatistik yaklaşımı
- İstatistiksel tahmin yöntemleri ve hipotez testi
- Korelasyon ve copula yöntemleri
- Korelasyon ve volatilitelerin EWMA ve GARCH modelleri ile tahmin edilmesi
- Volatilitate vade yapısı analizi
- Tek ve çok değişkenli doğrusal regresyon
- Zaman serileri analizi
- Simülasyon yöntemleri

• FİNANSAL PİYASALAR VE ÜRÜNLER

- Organize ve tezgah üstü piyasaların yapısı ve işleyişi
- Türev ürünler ile finansal korunma (hedging)
- Faiz oranları ve faiz duyarlılığı ölçütleri
- Kur riski
- Şirket bonoları
- İpotekli konut kredilerine (mortgage) dayalı menkul kıymetler
- Kredi derecelendirme kuruluşları

• DEĞERLEME VE RİSK MODELLERİ

- Riske maruz değer (RMD) yaklaşımı
- Beklenen kayıp yaklaşımı
- Stres testi ve senaryo analizi
- Opsiyon fiyatlaması
- Sabit getirili menkul kıymet değerlendirilmesi
- Finansal korunma (hedging)
- Ülke ve devlet riski ölçüm ve yönetim modelleri
- İçsel ve dışsal kredi derecelendirmeleri
- Beklenen ve beklenmeyen kayıplar
- Operasyonel risk

Telefon: +90 (212) 965 46 00 / 328 26 87

Faks: +90 (212) 328 26 88

E-Mail: egitim@riskturk.com



EĞİTMEN

Dr. Ayhan Yüksel, CFA, FRM, PRM



Dr. Ayhan Yüksel, Bankacılık Düzenleme ve Denetleme Kurumu'nda 10 yıl süre ile risk yönetimi biriminde görev almış, bu süre içerisinde risk yönetim modellerinin ve sistemlerinin bankalarda kurulmasına ve Basel Sermaye Uzlaşılarının ülkemizde uygulanmasına ilişkin önemli görevler üstlenmiştir. Sonrasında sermaye piyasası sektörüne geçerek yaklaşık 10 yıl boyunca sırasıyla çeşitli portföy yönetim şirketi ve aracı kurumlarda risk yönetimi, portföy yönetimi ve kantitatif araştırma konularında yönetici olarak görev almış, bu süre içerisinde algoritmik yatırım stratejilerinin geliştirilmesi ve uygulanması, fon ve portföy yöneticiliği görevlerini üstlenmiştir. Halen robo advisory ve algoritmik trading konularında fintech projeleri geliştirmektedir.

Dr. Yüksel'in finans ve risk yönetimine ilişkin sertifikalar konusunda önemli tecrübeleri bulunmaktadır. Kendisi finansal piyasalarda global çapta saygınlığı olan CFA, FRM ve PRM sertifikalarına sahip olup, PRM sınavında dünya çapında derece elde etmiştir. Ayrıca Sermaye Piyasası Kurulu (SPK) tarafından verilen lisanslama sınavlarında kaynak kitap olarak okutulan "Sermaye Piyasası Çalışmaları İçin Etik İlkeler" kitapçığının çevirmenleri arasında yer almış, CFA İstanbul Derneği tarafından organize edilen CFA Sınavına Hazırlık Kurslarında eğitmen olarak görev almış, çok sayıda banka ve reel sektör şirketine FRM sınavına hazırlık, finansal modelleme, algoritmik trading ve R programlama dili eğitimleri vermiştir. Dr. Yüksel daha önce Risk Yöneticileri Derneği (RYD) ve PRM Türkiye yönetim kurulu üyelikleri yapmıştır.

Dr. Ayhan Yüksel'in, Bilkent Üniversite'sinden işletme lisans, Warwick Üniversitesi'nden istatistik master ve ODTÜ'den finansal matematik master ve doktora dereceleri bulunmaktadır. Kendisi halen Boğaziçi Üniversitesi'nde yarı zamanlı öğretim üyesi olarak "Algorithmic Trading with R", "Investment Theory" ve "Theory of Finance" isimli dersleri vermektedir.

LinkedIn Profili: www.linkedin.com/in/ayhan-yuksel

FRM Sertifikasının Önemi

Global Association of Risk Professionals (GARP) tarafından düzenlenen Financial Risk Manager (FRM) sertifikası dünya çapında risk yönetimi konusundaki en prestijli sertifika programı konumundadır. Her yıl binlerce kişinin katıldığı sertifika programı hem dünyada hem de ülkemizde işverenlerce de önemli bir yetkinlik göstergesi olarak kabul edilmektedir. FRM sertifikası ile ilgili bazı bilgiler şu şekildedir:

- Düzenlenmeye başlandığı 1997 yılından bu yana FRM sınavına 150,000'den fazla kişi kayıt yaptırmıştır.
- FRM sınavına 350'den fazla farklı üniversitenin mezunları sınava kayıt yaptırmıştır.
- FRM sınavına kayıt yaptıranların sayısı 2010-2018 arasında yıllık %15 artış göstermiştir
- 2018 yılındaki FRM sınavına 67 binden fazla kişi kayıt yaptırmıştır
- FRM sınavına katılanların %90'ı çalışma arkadaşlarına sınava katılmalarını önermektedir.
- Halihazırda dünya çapında toplam 50,000'den fazla FRM sertifikalı çalışan bulunmaktadır.

FRM Programı her biri dört saatten oluşan iki aşamalı bir sınavdan oluşmaktadır. Planlanan eğitim programımız **sadece birinci aşamayı** kapsamaktadır. Sınavlardan her yıl Mayıs (2021 yılında Temmuz da eklendi) ve Kasım aylarında yapılmaktadır. Mayıs sınavı için **Ocak ayı sonuna** kadar, Kasım sınavı için de **Temmuz ayı sonuna** kadar başvuru yapılması durumunda indirimli fiyatlardan faydalanılması mümkündür.

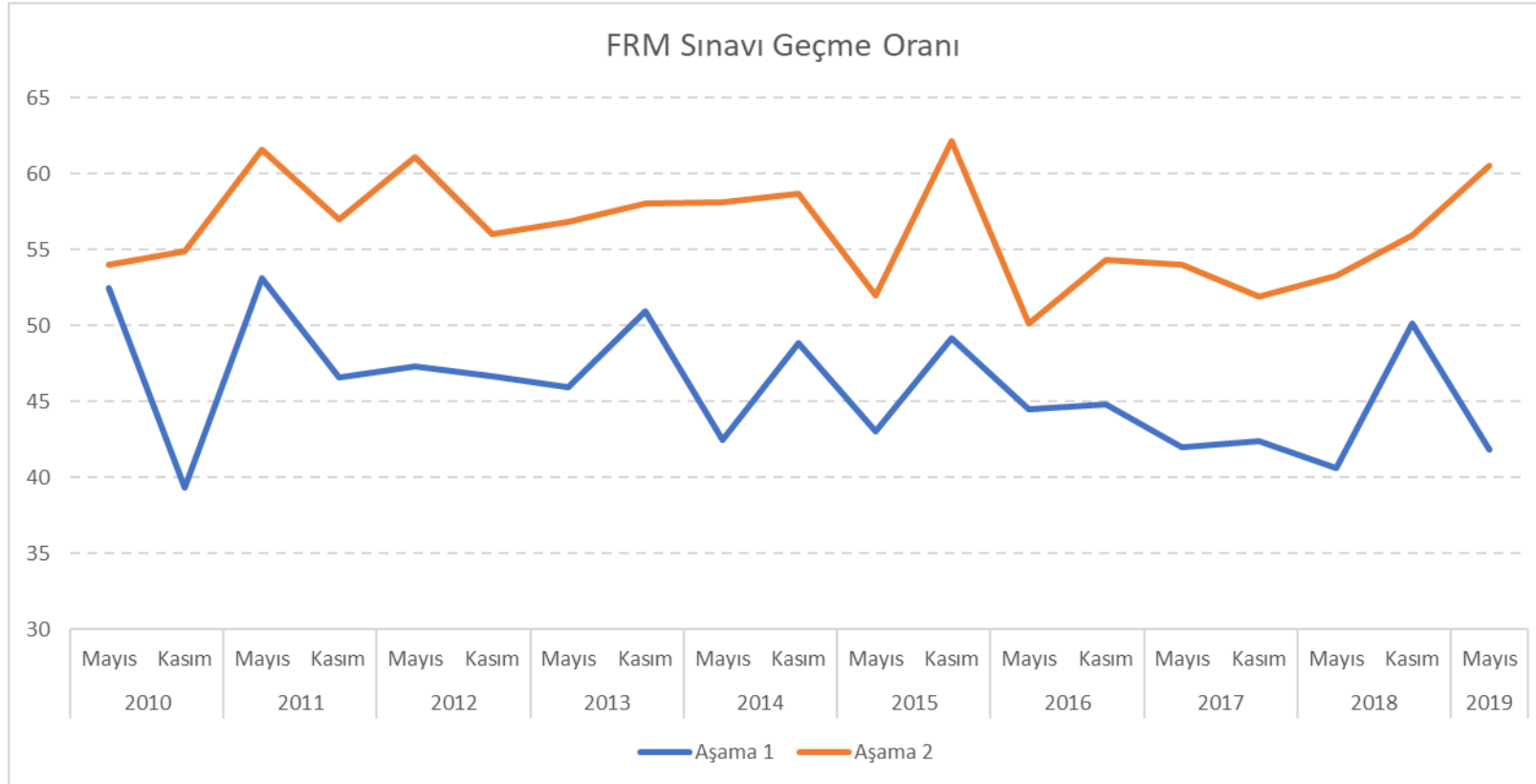
FRM Sınav İçeriği

FRM sınavlarının ilk aşaması risk yönetimine ilişkin temel kavramlar ve araçları kapsarken, ikinci aşama piyasa, kredi, operasyonel risk gibi spesifik risk türlerine ilişkin konuları kapsamaktadır. Her iki sınav da 4 saatlik çoktan seçmeli soru şeklinde uygulanmaktadır. Ayrıca sınavda sadece belirli markaların ürettiği finansal hesap makinelerinin kullanılmasına izin verilmektedir.

	Aşama I	Aşama II
Ana odak noktası	Risk yönetimine ilişkin temel kavramlar ve araçlar	İlk aşamda öğrenilen kavram ve araçların uygulanması ve temel risk türleri ile bunların yönetimine ilişkin daha detaylı bilgiler
Konu başlıkları	<ul style="list-style-type: none">• Foundations of risk management concepts• Quantitative analysis• Financial markets and products• Valuation and risk models	<ul style="list-style-type: none">• Market risk measurement and management• Credit risk measurement and management• Operational and integrated risk management• Risk management and investment management• Current issues in financial markets
Sınav formatı	Çoktan seçmeli sorular	Çoktan seçmeli sorular
Sorular	Eşit ağırlıklı 100 soru	Eşit ağırlıklı 80 soru
Sınav Süresi	4 saat	4 saat

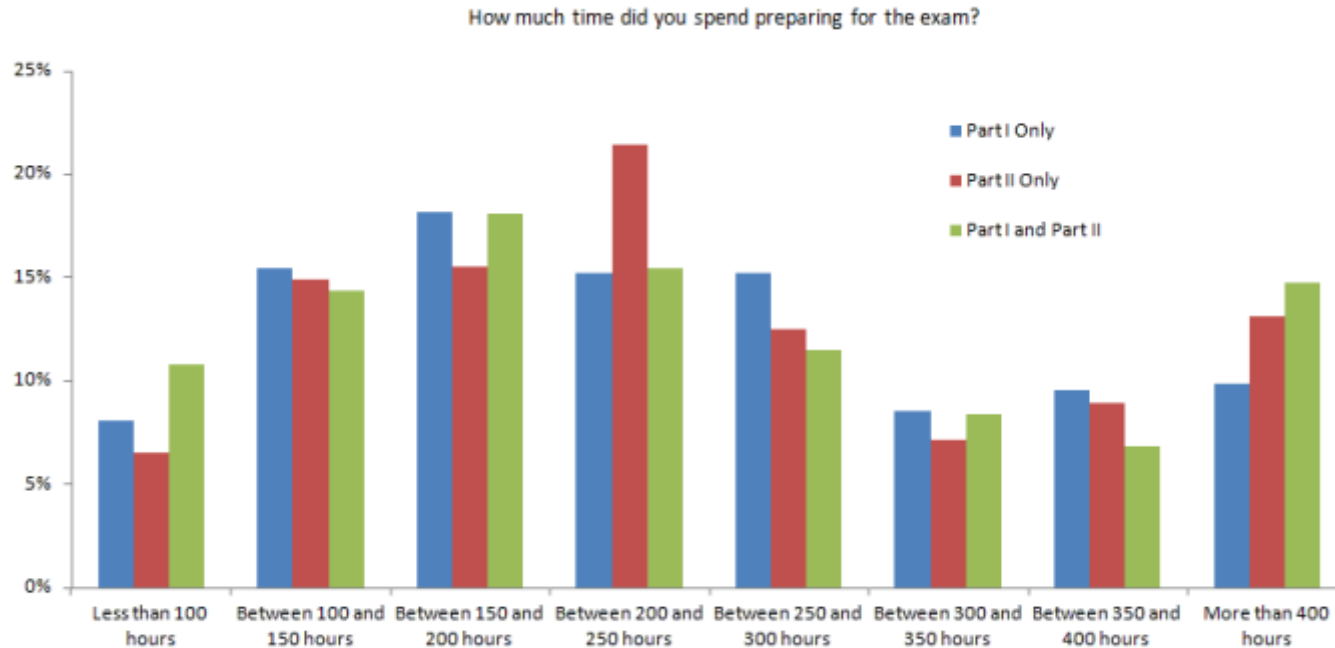
FRM Sınavı Başarı Oranları

FRM sertifikasına almak için iki sınavı da başarıyla tamamlamak gereklidir. Aynı anda iki sınava birden girmek mümkündür. Ancak bu durumda, sınavlardan her hangi birinden geçer not alınmaması durumunda, bir sonraki sefer yine her iki sınava birden katılmak gerekmektedir. Bu nedenle katılımcıların çoğu iki sınava farklı tarihlerde girmektedir. Sınavların toplamda 4 yıl içerisinde tamamlanması gerekmektedir. Sınavı geçme oranı ilk aşama için %50, ikinci aşama için %60 civarında olup, tarihsel gelişimi aşağıda yer almaktadır.



FRM Sınavına Hazırlık

FRM sınavı katılımcıları arasında yapılan ve aşağıda sonuçları yer alan bir ankette, katılımcıların sınava hazırlık için ortalama 240 saat çalıştıkları tespit edilmiştir. Ankette elde edilen değerler de “100 saatten az” ile “400 saatten fazla” arasında değişmektedir. Ancak finans sektöründe halihazırda çalışmakta olan birinin hem işyerindeki bilgi seti hem de üniversitede elde ettiği bilgiler dolayısıyla bahsedilen ortalama sürelerden daha az bir süreye ihtiyaç duyabilmesi mümkündür. Halihazırda çalışan adaylar için FRM sınavına hazırlık konusunda en kritik konu yeterli vakti ayırabilmektir. FRM sınavı kapsamının oldukça geniş olduğu dikkate alındığında, çalışan adaylar için konuların hızlı bir şekilde öğrenilmesi, çok sayıda test sorusunun çözülmesi ve testlerde yeterli başarı gösterilemeyen konularda hızlı bir şekilde destek alınarak öğrenim sürecinin tamamlanması önem arz etmektedir.



Telefon: +90 (212) 965 46 00 / 328 26 87

Faks: +90 (212) 328 26 88

E-Mail: egitim@riskturk.com



Eđitimler Hakkında Genel Bilgi

- Eđitim toplam 10 gündür.
- Online yapılacak eđitime ideal durumda 10-12 kiřinin katılması önerilmektedir.
- RiskTürk gerektiđinde programı erteleme ya da iptal etme hakkını saklı tutmaktadır.
- Program sonunda tüm katılımcılara katılım sertifikası verilmektedir.
- Sorularınız ve kayıtlar için ařađıdaki numaralardan bilgi alabilirsiniz.

Tlf: 0 (212) 965 46 00

Faks: 0 (212) 328 26 88

Email: egitim@riskturk.com

Web: www.riskturk.com

RISKTURK

Telefon: +90 (212) 965 46 00 / 328 26 87

Faks: +90 (212) 328 26 88

E-Mail: egitim@riskturk.com



EĞİTİM REFERANSLARIMIZ



RISKTURK