

Kurumsal Risk Yönetimi Hizmetleri



İstanbul Üniversitesi Entertech Teknopark No.37 | Avcılar | İstanbul
www.grcmngmnt.com



Tecrübe ve Geçmişimiz

Prof. Dr. Davut Pehlivanlı

- Türkiye Risk Raporu Direktörü, 5 yıldır gelenekselleşen risk raporu serisi.
- Kurumsallaşma, süreç yönetimi, BPM iş akışı, risk yönetimi, iç kontrol, iç denetim, iş zekası, alacak riski yönetimi, hile riski yönetimi, ERP projeleri olmak üzere katma değeri yüksek projeler.
- 100'ün üzerinde proje tecrübesi
- Yaklaşık 25 yıllık tecrübe
- Stratejik planlama, hedeflere dayalı şirket değerini büyütme ve çıkışın yürütülmesi
- Devam eden ar-ge projesi: Tübitak destekli 'Kurumların Planlama Süreçleri İçin Yapay Zeka Destekli Analiz ve Risk Skorlama Sisteminin Geliştirilmesi'

Hikayemiz

GRC Management, yönetim, risk ve uyum (Governance, Risk, Compliance - GRC) alanında faaliyet gösteren yenilikçi bir danışmanlık firmasıdır. Şirket, kuruluşundan itibaren global iş dünyasının ihtiyaçlarına yönelik özelleştirilmiş çözümler sunarak hızla büyümüştür. İş süreçlerinde risk yönetimi, uyum stratejileri ve kurumsal yönetim politikalarının geliştirilmesine odaklanan GRC Management, müşterilerine sürdürülebilir ve sağlam bir iş modeli oluşturmayı hedeflemektedir. Bu süreçte, teknolojiyi etkin bir şekilde kullanarak, sektördeki en güncel uygulamaları hayata geçirir.

GRC Management'in başarısının ardında, dinamik ve disiplinlerarası çözüm odaklı bakış alır. Şirket, müşterilerinin karşılaştığı kompleks düzenleyici gereksinimlere hızlı ve etkili çözümler üretirken, proaktif bir yaklaşım benimser. Sektördekiengin tecrübesiyle, GRC alanında öncü olmayı başarmış, stratejik danışmanlık hizmetleri sayesinde birçok işletmeye risk yönetiminde rehberlik etmiştir. GRC Management, her geçen gün gelişen iş dünyasının ihtiyaçlarına uyum sağlayarak büyümeye devam etmektedir.

Uzmanlık Alanlarımız

- M&A ve Halka Arz Hazırlık
- Dijital Cüzdan Projeleri
 - Altın sektörü projeleri
 - E-Para, Banka, Ürün, Entegrasyon, Müşteri Edinimi-Onboarding
- Kurumsal Yönetim
 - Kurumsallaşma ve Süreç Yönetimi, Dijital Dönüşüm
 - İç Kontrol Sistem Tasarımı
 - İç Denetim Sistem Tasarımı
 - Faaliyet Raporlaması ve İş Zekası Uygulamaları
 - Bütçe Tasarımı
- Maliyet Sistemi Tasarımı

Risk Yönetimi ve Algoritmalar

- Risk Yönetim Hizmetleri
 - Risk Yönetimi Sistem Tasarımı
 - Alacak Riski ve Yönetimi – Mali İstihbarat
 - Hazine Riski Yönetimi
 - Suistimal Riski Yönetimi
 - Yasal Uyum – Compliance
- Algoritma – Yazılım
 - Risk Skoreleme ve Algoritmaları
 - Riskonnect - Risk Yönetimi Yazılımları
 - 360° Müşteri Performans Yönetim Sistemi

Proje

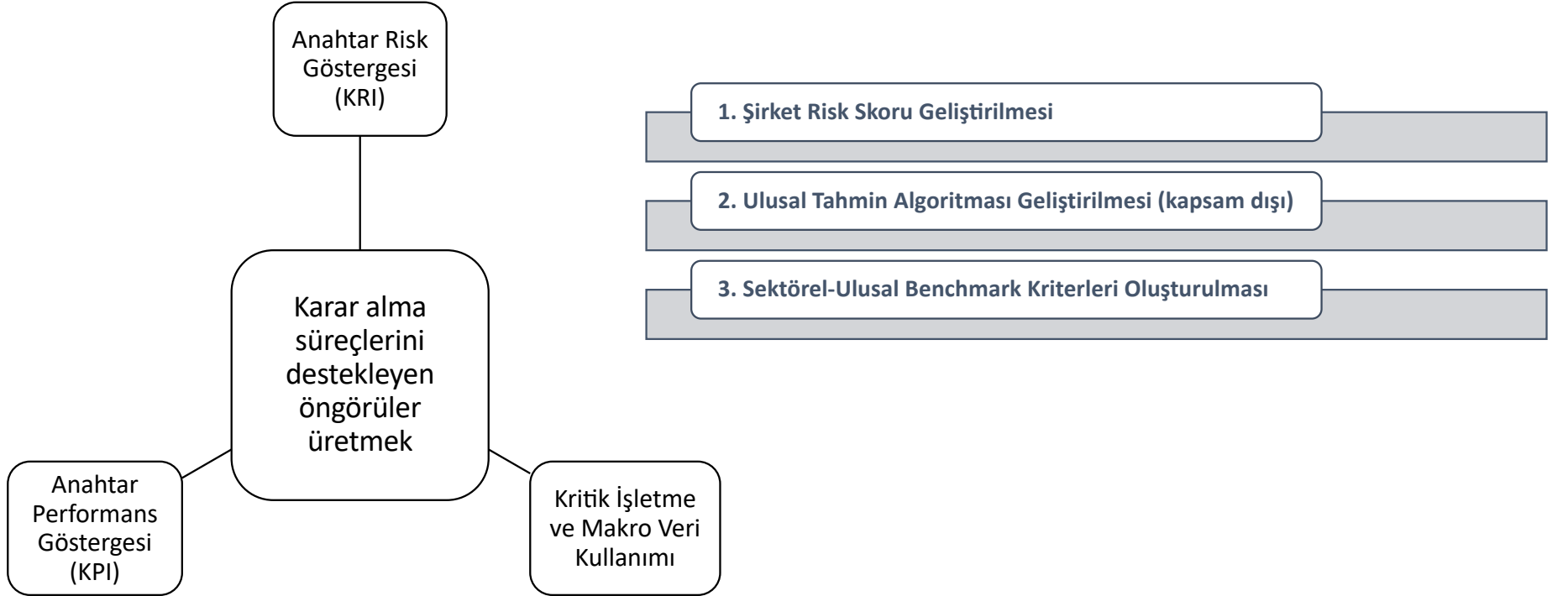
Tübitak 1501 Sanayi Ar-Ge Projeleri Destekleme Programı kapsamında destek alan Kurumların Planlama Süreçleri İçin Yapay Zeka Destekli Analiz ve Risk Skorlama Sisteminin Geliştirilmesi projesi çerçevesinde;

1. Şirket Risk Skoru Algoritması
2. Sektörel-Ulusal Benchmark
3. Ulusal Tahmin Algoritması

modülleri geliştirilecektir.

Bu kapsamda sizlerle işbirliği ile katma değerli hizmetleri vermek ve mevcut algoritmalarını geliştirmek temel hedefimizdir.

Kurumların Planlama Süreçleri İçin Yapay Zeka Destekli Analiz ve Risk Skorlama Sisteminin Geliştirilmesi



GRC | Risk Yönetimi Projeleri



Sigorta ve BES
Sektör Raporu –
Türkiye Sigorta

Sektörel Risk
Envanterleri
Oluşturulması – 11
Sektör
(İTO Projesi)

Bireysel Emeklilik
Sektörü Risk
Envanteri Projesi

Şirketler
STK'lar ve
Bireyler

BPM Risk
Yönetimi Yazılımı

Risk AI Proje Risk
Opto Tübitak

360° Müşteri
Performans
Yönetim Sistemi

Şirket Risk Skoru
Algoritması ve
Raporu

Şirket Projeleri



Ulusal Riskler



Sektörel Riskler



İşleme Seviyesinde
Riskler



İşletme ve
Makro
Ölçekte Risk
Tahminleme

- 11 sektörde risk envanteri geliştirilmesi
- KPI ölçümleri
- Çok boyutlu işletme performans yönetim sisteminin tasarımı (döviz riski, alacak riski, kredibilite riski vb)
- Risk Skoru algoritmasının geliştirilmesi ve testlerinin tamamlanması

Çıktı: Risk Skoru Algoritması



Introducing the overall risk scoring as an early warning system

Davut Pehlivanlı^{a, *}, Elçin Aykaç Alp^b, Bilge Katanalp^c

^a Istanbul University, Director of Risk and Audit Research Center, Istanbul, Türkiye

^b Istanbul Ticaret University, Faculty of Business, Istanbul, Türkiye

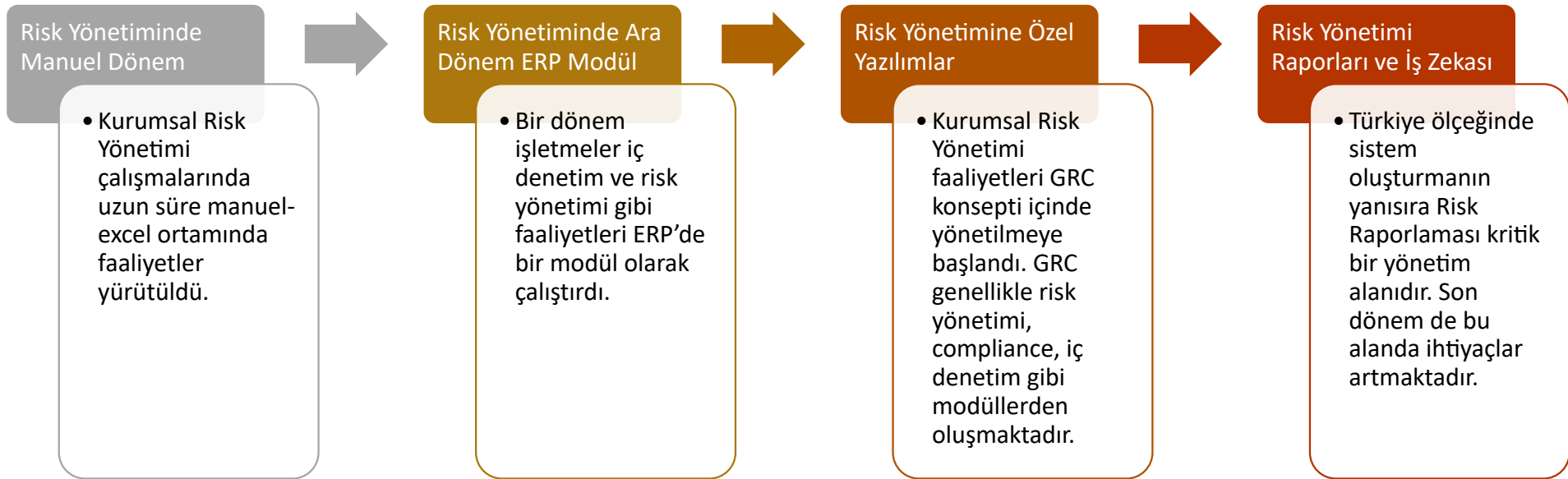
^c Sakarya University, Esentepe Campus, Sakarya Business School, 54187 Sakarya, Türkiye

ARTICLE INFO

Keywords:
Risk analysis
Dynamic models
Early warning system
Enterprise risk management
Overall risk scoring

ABSTRACT

Business performance is a critical field of study, which should be assessed in more than just credit risk in the banking context. However, much previous research takes business performance in the context of credit risk in the banking. In this study, risks will be analyzed to measure business performance in an integrated manner within the framework of non-financial sector dynamics. To this end, brainstorming sessions, risk workshops, surveys, and face-to-face interviews were held with representatives of small medium enterprises in 11 different sectors. Through field studies, risks have been identified and assessed in terms of impact and probability, Key Risk Indicators have been determined, and risks have been scored based on financial and non-financial metrics to estimate the Overall Risk Scoring. Moreover, the Overall Risk Scoring model has been tested using Logit Regression and Artificial Neural Networks (ANN), the Naïve Bayes Algorithm, and the C4.5 decision tree model. All methods have statistically verified that the predictive power of the structure of the Overall Risk Scoring is high. Our findings reveal that when business performance is analyzed with non-financial and financial metrics, dynamic and static data, market expectations, and banking needs, the predictive power of the calculated Overall Risk Scoring increases. The created Overall Risk Scoring Model can be used as an early warning system for many objectives by business executives, suppliers, consumers, investors, financial institutions, public bodies, credit rating agencies, and entities like the Credit Guarantee Fund.



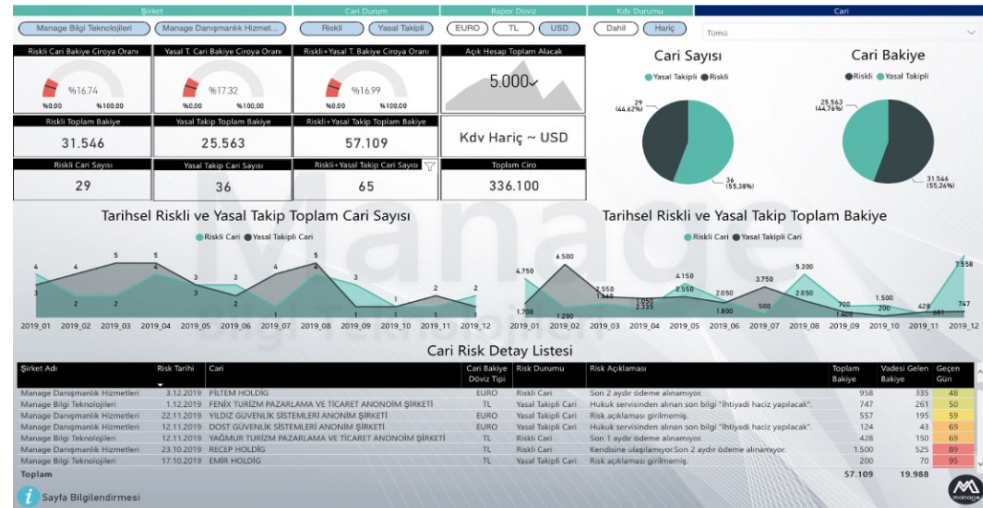
Rapor türleri

- Finans, hazine ve diğer departmanlar özelinde raporlar.
 - Hazine raporu
 - Döviz pozisyon raporu gibi.
- Aylık üst yönetim raporları.
 - Üst yönetim faaliyet raporunda kullanılacak raporlar.
- Düzenleyici otorite için rapor formatları.
 - BDDK ve SPK gibi üst otorite raporları.

Rapor türleri

- Hazine riskleri
- Kredibilite riski
- Faiz riski
- Likidite riski
- Kur riski
- Döviz-metal pozisyon riski
- Alacak-batak-iflas riski
- Yoğunlaşma riski
- Sipariş-bağlantı riski

- Teminat yönetimi riski
- Stok riski
- Verimlilik-Karlılık riski
- Operasyonel riskler



Aylık rapor ihtiyacı

- Aylık üst yönetim raporu word şablonları ile çözülebilmektedir.
- İş zekası ilgili raporları sunum-word-pdf olarak yönetim sunum formatında çıktıya dönüştürebilir.

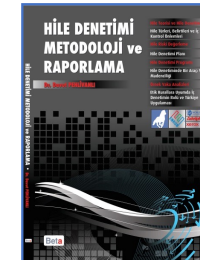
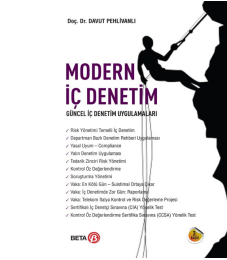
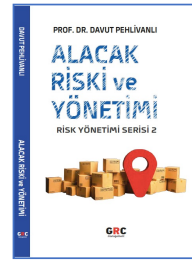
Risk Yönetimi Raporu

Ekim 2015
Yönetim Kurulu Başkanı

14.10.2015
"İhmat Kontrolle Mamı Değildir"



Türkiye Risk Raporları Serisi 2020, 2021, 2022, 2023 ve 2024



Risk Bülteni ve Kitaplar

Kurumsal Risk Yönetimi Hizmetleri

Prof. Dr. Davut Pehlivanlı

Türkiye Risk Raporu Direktörü

Direktör / Risk ve Denetim Araştırma Merkezi / İstanbul Üniversitesi Siyasal Bilgiler

Fakültesi

Kurucu / GRC Management / Risk Referans

Bağımsız Yönetim Kurulu Üyesi (Sanayi Şirketi)



İstanbul Üniversitesi Entertech Teknopark No.37 | Avcılar | İstanbul
www.grcmngmnt.com

