

## SILABUS TRAINING

# “DERIVATIVES RISK MANAGEMENT: TEKNIK PENGUKURAN MARKET RISK, CREDIT RISK, DAN COUNTERPARTY RISK”

Hari/Tanggal : **Senin-Selasa, 18-19 Mei 2026**  
Durasi & Waktu : **2 Hari, 08.30-16.00 WIB**  
Lokasi : **Bandung**

### LATAR BELAKANG

Instrumen derivatif seperti swaps, options, forwards, dan futures adalah alat lindung nilai (hedging) yang sangat efektif, namun membawa risiko bawaan yang signifikan jika tidak dikelola dengan tepat. Kegagalan dalam mengukur risiko derivatif sering kali bersumber dari ketidakmampuan membedakan antara pergerakan harga pasar dengan risiko gagal bayar lawan transaksi.

Training Derivatives Risk Management ini akan membedah tiga pilar risiko utama secara mendalam. Peserta tidak hanya diajarkan cara menghitung potensi kerugian, tetapi juga bagaimana menerapkan teknik mitigasi modern seperti Collateral Management dan pemahaman atas eksposur kredit masa depan yang bersifat dinamis.

### TUJUAN

1. Menguasai Pengukuran Market Risk
2. Memitigasi Counterparty Credit Risk (CCR)
3. Implementasi Netting & Collateral
4. Melakukan stress testing pada instrumen derivatif terhadap perubahan suku bunga, nilai tukar, dan volatilitas ekstrim.
5. Memahami standar Basel III terkait permodalan untuk risiko Counterparty.

## MATERI

1. Karakteristik Risiko Instrumen Derivatif
  - Struktur risiko pada instrumen Linear (Forwards/Swaps) vs. Non-Linear (Options).
  - Sumber risiko: Delta, Gamma, Vega, Theta, dan Rho (The Greeks).
2. Estimasi Market Risk dengan VaR
  - Penerapan Delta-Normal, Historical Simulation, dan Monte Carlo pada derivatif.
  - Backtesting dan validasi model risiko pasar.
3. Liquidity Risk dalam Transaksi Derivatif
  - Risiko likuiditas pasar vs. likuiditas pendanaan (Margin Calls).
4. Dasar Counterparty Credit Risk (CCR)
  - Perbedaan Lending Risk vs. Counterparty Risk.
  - Menghitung Current Exposure dan Potential Future Exposure (PFE).
5. Credit Valuation Adjustment (CVA)
  - Konsep Pricing Risk: Memasukkan risiko gagal bayar lawan transaksi ke dalam harga derivatif.
  - Pengenalan Wrong-Way Risk (WWR).
6. Mitigasi Risiko melalui Dokumentasi & Kolateral
  - Aspek kunci ISDA Master Agreement.
  - Mekanisme Initial Margin dan Variation Margin.
  - Central Clearing (CCP) vs. Bilateral Trades.
7. Stress Testing & Regulatory Capital
  - Simulasi krisis pada eksposur derivatif.
  - Perhitungan permodalan untuk CCR sesuai standar Basel III/IV.

## PESERTA

Treasury, Market & Credit Risk Analyst, Product Control, Audit Internal, Kepatuhan / Compliance

## INVESTASI

- Investasi Normal : Rp. 6.500.000,- Per Peserta
- Investasi Grup : Diskon 10% dari Investasi Normal Per Peserta untuk pendaftaran minimal 5 peserta
- Fasilitas yang di dapat : Sertifikat Cetak, Modul (hardcopy/cetak dan softcopy via email),

Training KIT, Souvenir (T-shirt/Jaket/Tumbler - menyesuaikan stok),  
Meeting Room dan Fasilitasnya, Konsumsi selama Training, PPh  
Non Fasilitas : Transportasi dan Akomodasi Peserta, PPN

**Catatan Pendaftaran Grup:**

Untuk pendaftaran grup (minimal 5 peserta), peserta bisa *request* jadwal atau *request private class*

**\*INFORMASI LEBIH LANJUT, PENDAFTARAN & INHOUSE TRAINING\***

**The Infinity Academy | PT Infinity Berkah Indonesia**

Email: [marketing@infinityacademy.co.id](mailto:marketing@infinityacademy.co.id)

Website : [www.infinityacademy.co.id](http://www.infinityacademy.co.id);

Sosial Media: (Instagram) theinfinity.academy; (Tiktok) theinfinity.acad

**Marketing:**

**Ratna Samiah (Public dan Inhouse Training)**

No Hp: 0811-9878785

Email: [ratna.infinityacademy@gmail.com](mailto:ratna.infinityacademy@gmail.com)

**Vina Firmalia (Inhouse Training)**

No Hp: 0812-1849 9009

Email: [vinafirmalia.infinityacademy@gmail.com](mailto:vinafirmalia.infinityacademy@gmail.com)