

SILABUS TRAINING

“INTEGRATED RISK MANAGEMENT FOR TREASURY: STRESS TESTING AND BASEL III/IV STANDARDS”

Hari/Tanggal : Senin-Selasa, 4-5 Mei 2026

Durasi & Waktu : 2 Hari, 08.30-16.00 WIB

Lokasi : Jakarta

LATAR BELAKANG

Dalam lanskap keuangan saat ini, fungsi Treasury bukan sekadar pusat pengelolaan kas, melainkan benteng pertahanan risiko. Dengan implementasi penuh standar Basel III dan transisi menuju Basel IV, bank dituntut untuk memiliki modal yang lebih kuat dan manajemen likuiditas yang lebih transparan.

Pelatihan ini memberikan pemahaman mendalam tentang bagaimana mengintegrasikan risiko pasar, risiko likuiditas, dan risiko kredit dalam satu kerangka kerja yang koheren. Peserta akan mempelajari cara membangun skenario simulasi krisis (stress testing) yang tidak hanya memenuhi kepatuhan regulasi, tetapi juga memberikan nilai tambah bagi pengambilan keputusan strategis.

TUJUAN

1. Memahami Arsitektur Basel III/IV: Menguasai standar rasio kecukupan modal dan likuiditas (LCR, NSFR, dan Leverage Ratio).
2. Implementasi Stress Testing
3. Optimalisasi Asset Liability Management (ALM)
4. Mitigasi Risiko Terintegrasi
5. Kepatuhan Regulasi: Memastikan operasional Treasury selaras dengan aturan OJK dan standar internasional terbaru.

MATERI

Hari Pertama: Fondasi Regulasi & Manajemen Risiko Pasar

1. Evolusi dari Basel III ke Basel IV
 - Perubahan kunci dalam perhitungan RWA (Risk Weighted Assets).

- Fokus pada transparansi dan standarisasi internal model.
- 2. Manajemen Risiko Likuiditas Global
 - Mekanisme Liquidity Coverage Ratio (LCR) dan Net Stable Funding Ratio (NSFR).
 - Pengelolaan Intraday Liquidity.
- 3. Market Risk & Fundamental Review of the Trading Book (FRTB)
 - Standardized Approach vs. Internal Model Approach.
 - Dampak FRTB terhadap biaya modal unit Treasury.
- 4. Workshop Simulasi Likuiditas
 - Studi kasus: Menghitung gap likuiditas dalam kondisi normal vs. krisis.

Hari Kedua: Stress Testing & Integrasi Risiko

1. Kerangka Kerja Stress Testing Terintegrasi
 - Metode Sensitivity Analysis vs. Scenario Analysis.
 - Desain skenario: Macroeconomic shocks dan Idiosyncratic events.
2. Interest Rate Risk in the Banking Book (IRRBB)
 - Mengukur dampak fluktuasi suku bunga terhadap EVE (Economic Value of Equity) dan NII (Net Interest Income).
3. Integrasi Risiko dalam Capital Planning
 - Menghubungkan hasil Stress Test dengan ICAAP (Internal Capital Adequacy Assessment Process).
 - Alokasi modal berbasis risiko (Risk-Based Capital Allocation).
4. Diskusi Panel & Penyusunan Action Plan
 - Strategi mitigasi risiko di tengah ketidakpastian ekonomi global.
 - Penyusunan laporan manajemen risiko yang efektif untuk Direksi.

PESERTA

Treasury, Risk Management, ALM, Compliance, Internal Auditor, Financial Controller, Strategic Planning, Data Scientist, Quantitative Analyst

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, 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

Website : 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

Vina Firmalia (Inhouse Training)

No Hp: 0812-1849 9009

Email: vinafirmalia.infinityacademy@gmail.com