



**RISIKO
MANAJEMEN
GAGASAN**
LEMBAGA PENGEMBANGAN PROFESI



ed-learning
education by digital platform

IMPLEMENTASI PERHITUNGAN ATMR UNTUK RISIKO PASAR MENGUNAKAN METODE STANDAR

KONSULTANSI

TUJUAN

- 01** Menyelenggarakan regulasi terkait ATMR untuk Risiko Pasar dengan benar.
- 02** Melaksanakan Perhitungan ATMR untuk Risiko Pasar bagi Bank Umum (konvensional dan syariah) sesuai dengan ketentuan OJK terbaru (sesuai Basel III Reforms), baik menggunakan metode Standardized Approach (SA) maupun metode Simplified Standardised Approach (SSA).
- 03** Memahami perbedaan Perhitungan ATMR untuk Risiko Pasar bagi Bank umum dengan menggunakan metode eksisting (Standardized Approach sebelumnya) dengan ketentuan OJK terbaru yang mengacu pada sesuai Basel III Reforms.
- 04** Menyusun ketentuan (SOP/Juknis) atas perhitungan ATMR untuk Risiko Pasar sesuai dengan metode terbaru (sesuai Basel III Reforms).
- 05** Menindaklanjuti pengklasifikasian dan pengaturan antara trading book dan banking book, terutama dikaitkan dengan struktur organisasi Bank dan kondisi pengaturan antara trading book dan banking book yang ada saat ini.

- 06** Memahami data yang dibutuhkan dalam perhitungan ATMR untuk Risiko Pasar.
- 07** Melakukan mapping data dari Antasena untuk digunakan dalam perhitungan ATMR untuk Risiko Pasar sesuai dengan kertas kerja (template) yang telah disediakan oleh regulator (OJK).
- 08** Mampu memenuhi Pelaporan Uji Coba Perhitungan.
- 09** Melaksanakan evaluasi (review) atas metode perhitungan ATMR untuk Risiko Pasar dengan metode terbaru (sesuai Basel III Reforms) yang telah disusun.
- 10** Memahami klasifikasi dan pengaturan antara trading book dan banking book, terutama terkait batasan klasifikasi instrumen, list instrumen, serta pembatasan perpindahan instrumen trading book dan banking book.
- 11** Menyusun materi presentasi, menginterpretasikan, dan menjelaskan kepada manajemen maupun kepada regulator atas hasil assessment dalam hal menentukan metode yang sesuai (SA ataupun SSA) dengan kondisi Bank saat ini dengan mempertimbangkan rencana bisnis Bank jangka pendek maupun jangka panjang.

