



2-DAY WORKSHOP FIRM-WIDE STRESS TESTING Using Web-App & Mobile App

Sinopsis

Peraturan Otoritas Jasa Keuangan (POJK) Nomor 5 Tahun 2024 mengatur tentang Penetapan Status Pengawasan dan Penanganan Permasalahan Bank Umum. Salah satu yang diatur adalah kewajiban Bank untuk menyusun dan menguji Rencana Aksi Pemulihan secara berkala melalui stress testing. Hal ini bertujuan untuk memastikan bahwa bank memiliki strategi yang efektif dalam menghadapi situasi krisis. ISEI kembali menawarkan Workshop dua hari: "Firm-Wide Stress Testing". Workshop ini sangat sesuai bagi profesional yang ingin mendapatkan pemahaman tentang stress testing yang komprehensif terhadap risiko fundamental termasuk metodologi dan berbagai pemodelan risiko untuk Scenario-Based Stress Testing. Peserta diharapkan dapat melakukan pemodelan dampak economic growth misalnya, atau macro-economic variable lainnya terhadap ODR, NPL atau risk indeks lainnya. Peserta akan mempelajari penggunaan machine learning yang dilengkapi dengan contoh pemodelan real menggunakan program R dalam bentuk web app & mobile app. Selain itu juga peserta juga akan memahami pembuatan scenario menggunakan Monte Carlo Simulation dan juga pembahasan mengenai climate risk stress testing & reverse stress testing.



Fasilitator:

BENNY K. YUDIAATMAJA, FRM

Benny aktif sebagai konsultan pemodelan risiko pasar, *IRRBB*, risiko kredit & risiko operasional dan perancang *software* manajemen risiko di beberapa bank. Benny juga mengajar mata kuliah Risk Modelling di Magister Ekonomi Terapan UNIKA Atma Jaya. Benny lulus *cum laude* Sarjana Matematika ITB dan Magister Manajemen Risiko UI. Gelar profesi international *Financial Risk Manager (FRM)* diperoleh dari *Global Association of Risk Profesional (GARP)*.

Agenda Pelatihan

- 1 INTRODUCTION TO STRESS TESTING
- 2 MEASURES OF CORE RISKS
- 3 RISK MODELLING
- 4 STRESS TEST METHODOLOGIES
- 5 STRESS TEST - MARKET RISK & IRRBB
- 6 PERFORMING STRESS TEST - CREDIT RISK
- 7 PERFORMING STRESS TEST - LIQUIDITY RISK, OpRISK & OTHER RISK
- 8 RISK INTEGRATION, CLIMATE RISK & REVERSE STRESS TEST



INVESTASI

Rp 3.500.000 (Materi Presentasi, *Spreadsheet* dan *web-based online app* untuk pemodelan *machine learning*, *workshop kits* & E-Certificate)



VENUE

Kantor ISEI Pusat,

JL. Daksa IV No. 09, Kebayoran Baru,
Jakarta Selatan



TIME

Senin & Selasa, 09 - 10 September 2024
Pukul 09.00 - 16.30 WIB



INFORMATION

Peserta diharapkan membawa *notebook* atau tablet yang dapat terhubung dengan internet. Pendaftaran hanya dibuka dengan kapasitas 25 peserta.

Link Pendaftaran: bit.ly/ISEIStressTestingPOJK

Silabus Workshop : bit.ly/ISEIModulStressTestingPOJK



+62-882-2734-8958 (Jonathan)



isei.pusat@gmail.com



ppisei_official