

FOREIGN EXCHANGE & INTEREST RATE RISK MANAGEMENT

Pendahuluan

Perubahan nilai tukar valuta asing dan tingkat suku bunga dapat memberikan dampak signifikan terhadap **profitabilitas, cash flow, nilai aset dan liabilitas, biaya pendanaan, serta nilai perusahaan**. Eksposur tersebut dapat muncul dari aktivitas perdagangan internasional, pinjaman dalam mata uang asing, investasi, impor bahan baku, ekspor, transaksi antarperusahaan, maupun struktur pendanaan dengan tingkat bunga mengambang.

Trainer: Joko Suparto, S.E., Ak., M.M., CA, CELM, CIDM, CNHC,

WAKTU PELAKSANAAN

12 - 13 Oktober 2027

09:00 - 17:00 WIB

TEMPAT PELATIHAN

Location: Kuretakeso Hotel - Kemang / Best Western Premier - Cawang / The Aryaduta Hotel Semanggi

Harga

Group Price: Rp 5.350.000
Full Fare: Rp 5.950.000

**) Harga di atas tidak dikenakan PPN 11%, sudah termasuk makan siang, snack, sertifikat, dan modul.*

Foreign Exchange (FX) Risk dan Interest Rate Risk tidak hanya menjadi perhatian Treasury, tetapi juga merupakan bagian penting dari **Enterprise Risk Management dan Financial Risk Management**. Pengelolaan yang efektif membutuhkan pemahaman mengenai sumber risiko, pengukuran eksposur, forecasting, limit, hedging strategy, serta penggunaan instrumen derivatif.

Pelatihan ini memberikan pemahaman menyeluruh mulai dari konsep dasar hingga aplikasi praktis, sehingga peserta mampu menerjemahkan perubahan kurs dan suku bunga menjadi dampak finansial serta menentukan alternatif mitigasi yang sesuai.

Latar Belakang

Fluktuasi nilai tukar dan suku bunga dapat memengaruhi biaya pendanaan, arus kas, profitabilitas, nilai aset dan liabilitas, serta kinerja perusahaan. Perusahaan yang memiliki transaksi dalam valuta asing atau pendanaan dengan bunga mengambang perlu memahami sumber dan besarnya eksposur serta menentukan strategi mitigasi yang tepat agar dampak volatilitas pasar dapat dikendalikan.

Tujuan

Setelah mengikuti pelatihan, peserta diharapkan mampu:

- Memahami konsep **Foreign Exchange Risk** dan **Interest Rate Risk**.
- Mengidentifikasi berbagai jenis eksposur valuta asing dan suku bunga.
- Mengukur dampak perubahan kurs dan suku bunga terhadap keuangan perusahaan.
- Melakukan **sensitivity analysis** dan **stress testing**.
- Memahami strategi **natural hedging** dan financial hedging.
- Memahami penggunaan **forward, option, swap, interest rate swap, cap, floor, dan collar** .
- Menentukan alternatif mitigasi risiko sesuai eksposur dan kebutuhan perusahaan.
- Memahami prinsip monitoring, limit, dan pelaporan risiko.

OUTLINE

HARI 1

FOREIGN EXCHANGE RISK MANAGEMENT

Sesi 1 Fundamental Financial Risk Management

- Konsep financial risk
- Market risk dan FX risk
- Risk identification, measurement, monitoring & control
- Risk appetite, tolerance & limit

Sesi 2 Foreign Exchange Market

- Konsep nilai tukar dan currency quotation
- Spot rate dan forward rate
- Bid, ask dan spread
- Faktor yang memengaruhi nilai tukar

Sesi 3 Foreign Exchange Exposure

- Transaction Exposure
- Translation Exposure
- Economic/Operating Exposure

- Identifikasi currency exposure
- Net foreign currency position

Sesi 4 FX Risk Measurement

- Exposure mapping
- Sensitivity analysis
- Scenario analysis
- Stress testing
- Dampak perubahan kurs terhadap cash flow dan profit

Sesi 5 FX Hedging Strategy

- Natural hedging
- Financial hedging
- Hedge ratio
- Hedging policy dan limit
- Pemilihan strategi hedging

Sesi 6 FX Derivatives

- Forward
- Futures
- Currency option
- Currency swap
- Perbandingan biaya, risiko dan fleksibilitas instrumen

OUTLINE HARI 2

INTEREST RATE RISK MANAGEMENT

Sesi 1 Interest Rate Risk Fundamentals

- Konsep interest rate risk
- Fixed vs floating interest rate
- Sumber interest rate exposure
- Dampak perubahan suku bunga terhadap profit dan cash flow

Sesi 2 Interest Rate Exposure

- Repricing risk
- Yield curve risk
- Basis risk
- Optionality risk
- Asset-liability mismatch

Sesi 3 Interest Rate Risk Measurement

- Repricing gap
- Maturity gap
- Sensitivity analysis
- Scenario analysis
- Stress testing
- Duration dan Modified Duration

Sesi 4 Interest Rate Hedging

- Natural hedging
- Interest rate swap
- Pay Fixed / Receive Floating
- Pay Floating / Receive Fixed
- Interest rate cap
- Interest rate floor
- Interest rate collar

Sesi 5 Integrated FX & Interest Rate Risk

- Kombinasi **currency risk dan interest rate risk**
- Cross-currency exposure
- Cross-currency swap
- Integrated hedging strategy
- Hedging cost vs risk reduction

Sesi 6 Risk Management Framework & Dashboard

- Risk appetite dan risk limit
- Hedge ratio
- Monitoring exposure
- Hedging effectiveness
- Risk reporting

Metode Pelatihan

Pelatihan diarahkan agar peserta tidak hanya memahami konsep, tetapi mampu menerapkannya dalam proses **identifikasi -> pengukuran -> mitigasi -> monitoring -> reporting** risiko valuta asing dan suku bunga.

Instruktur Pelatihan

Joko Suparto, S.E., Ak., M.M., CA, CELM, CIDM, CNHC,

Joko Suparto, Memiliki pengalaman lebih dari 30 tahun dalam bidang akuntansi, keuangan, treasury, audit, kontrol keuangan, perpajakan, dan manajemen. Selain memiliki keahlian di bidang keuangan dan akuntansi, beliau juga memiliki kompetensi dalam hardware dan software melalui berbagai pelatihan dan workshop. Sepanjang kariernya, beliau telah menduduki berbagai posisi strategis sebagai Senior Auditor, Senior Manager, General Manager – Finance & Accounting, hingga Finance Director di perusahaan lokal maupun multinasional. Industri yang pernah beliau tekuni mencakup perbankan, properti & perhotelan, farmasi, logistik, consumer goods & trading, telekomunikasi, minyak & gas, serta perkebunan kelapa sawit.

Selain aktif dalam dunia korporasi, Joko Suparto juga berperan sebagai narasumber dalam berbagai pelatihan dan workshop di bidang analisis bisnis, perencanaan keuangan, manajemen treasury, audit investigasi, manajemen investasi, serta penerapan standar akuntansi seperti IFRS dan PSAK. Beliau juga memiliki pengalaman memberikan pelatihan di berbagai perusahaan besar, termasuk PT Indocement Tunggal Prakarsa Tbk., PT Indomobil Group, PT Astra Honda Motor, PT Bank J Trust, PT Telkom Indonesia, dan banyak lainnya. Dengan latar belakang pendidikan Magister Manajemen di bidang keuangan serta Sarjana Akuntansi dari Fakultas Ekonomi dan Bisnis Universitas Indonesia, beliau juga memegang berbagai sertifikasi profesional seperti Certified Accountant (CA). Saat ini, beliau menjabat sebagai Co-Founder & Director di MBA Consultant, dosen di beberapa universitas swasta, serta trainer dan konsultan bagi berbagai perusahaan.

CONTACT US

Operational Office

ILP CENTER 2nd Floor R19, Jl. Raya Pasar Minggu 39A, Jakarta Selatan

Phone

+62 813-8834-2078

Email

regtraining@valueconsulttraining.com

Website

www.valueconsulttraining.com