

LAMPIRAN III
 PERATURAN OTORITAS JASA KEUANGAN
 NOMOR /SEOJK.03/2017
 TENTANG PEDOMAN PENERAPAN
 MANAJEMEN RISIKO DAN PENGUKURAN
 RISIKO PENDEKATAN STANDAR UNTUK
 RISIKO SUKU BUNGA DALAM *BANKING
 BOOK (INTEREST RATE RISK IN THE
 BANKING BOOK)* BAGI BANK UMUM

LAPORAN PENGUNGKAPAN KEBIJAKAN MANAJEMEN RISIKO IRRBB

Nama Bank : PT Bank.... (individu/konsolidasi)*

Posisi Laporan : Bulan/Tahun

Analisis Kualitatif	
a	Penjelasan mengenai bagaimana bank mendefinisikan IRRBB untuk pengukuran dan pengendalian risiko.
b	Penjelasan mengenai strategi manajemen dan mitigasi IRRBB.
c	Periodisasi perhitungan IRRBB bank, dan penjelasan mengenai tindakan spesifik yang digunakan bank untuk mengukur sensitivitas terhadap IRRBB.
d	Penjelasan mengenai skenario <i>shock</i> suku bunga dan skenario <i>stress</i> yang digunakan bank untuk mengestimasi perubahan <i>economic value</i> dan <i>earnings</i> .
e	Asumsi permodelan yang digunakan secara signifikan dalam <i>Internal Measurement System (IMS)</i> – apabila ada.
f	Penjelasan mengenai bagaimana bank melakukan lindung nilai terhadap IRRBB (apabila ada), beserta perlakuan akuntansi terkait.
g	Penjelasan komprehensif mengenai asumsi utama pemodelan dan parametrik yang digunakan dalam menghitung ΔEVE dan ΔNII .
h	(Opsional) Informasi lainnya yang ingin diungkapkan oleh bank terkait interpretasi bank terhadap signifikansi dan sensitivitas hasil pengukuran IRRBB yang telah diungkapkan dan/atau penjelasan terhadap variasi yang signifikan pada tingkat IRRBB yang dilaporkan dibandingkan dengan pengungkapan sebelumnya.

Analisis Kuantitatif	
1	Rata-rata <i>repricing maturity</i> yang diterapkan untuk NMD.
2	<i>Repricing maturity</i> terpanjang yang diterapkan untuk NMD.

KETUA DEWAN
KOMISIONER
OTORITAS JASA KEUANGAN,

WIMBOH SANTOSO

LAPORAN HASIL PERHITUNGAN IRRBB

Nama Bank : PT Bank.... (individu/konsolidasi)*

Posisi Laporan : Bulan/Tahun

Dalam Juta Rupiah	Δ EVE		Δ NII	
Periode	T	T-1	T	T-1
<i>Parallel up</i>				
<i>Parallel down</i>				
<i>Steeper</i>				
<i>Flattener</i>				
<i>Short rate up</i>				
<i>Short rate down</i>				
Nilai Maksimum Negatif (absolut)				
Periode	T		T-1	
Modal <i>Tier 1</i>				
Nilai Maksimum dibagi Modal <i>Tier 1</i> atau <i>Projected Income</i>				

