

DAFTAR ISI

Halaman Judul	i
Halaman Pengesahan	ii
Halaman Pernyataan Bebas Plagiarisme	iii
Halaman Motto.....	iv
Halaman Persembahan.....	v
Kata Pengantar.....	vi
Daftar Isi.....	viii
Daftar Tabel.....	xi
Daftar Gambar.....	xii
Daftar Lampiran.....	xiii
Intisari	xiv
Abstract	xvi
BAB I. PENDAHULUAN	
1.1. Latar Belakang	1
1.2. Permasalahan	3
1.3. Batasan Masalah	4
1.4. Tujuan penelitian	4
1.5. Manfaat Penelitian	5
1.6. Landasan Teori.....	5
1.7. Metodologi Penelitian	10
1.8. Sistematika Penulisan	13
BAB II. LANDASAN TEORI	
2.1. Manajemen Risiko Perbankan	14
2.2. Risiko-Risiko Institusi Perbankan	16
2.3. Sebuah pendekatan Manajemen Risiko	23
2.4. <i>Value at Risk</i> (VaR)	25
2.5. Metodologi <i>Value at Risk</i> (VaR) dengan metode Simulasi Historis	29

2.6. VaR sebagai <i>Capital at Risk</i>	34
2.7. Kebutuhan modal risiko pasar untuk <i>regulator</i>	36
2.8. <i>Back Testing</i>	41
2.9. <i>Stress – Testing</i>	41
2.10. Risiko Pasar	43
2.11. Permodalan Bank	46

BAB III. METODOLOGI PENELITIAN

3.1. Jenis penelitian	50
3.2. Lokasi Penelitian	50
3.3. Metode Pengumpulan data	50
3.4. Sumber data	51
3.5. Metode analisis data	51

BAB IV. ANALISIS DAN PEMBAHASAN PENELITIAN

4.1. Manajemen Risiko Perbankan	53
4.2. Risiko – risiko institusi Perbankan	54
4.3. Sebuah pendekatan Manajemen Risiko	59
4.4. Perhitungan risiko pasar dengan Metode Simulasi Historis.....	61
4.5. Kebutuhan modal secara ekonomis	63
4.6. Kebutuhan modal untuk <i>regulator</i>	65
4.7. Implementasi <i>back testing</i> dan <i>stress testing</i>	66
4.8. Permodalan Bank	67

BAB V. KESIMPULAN DAN SARAN

5.1. Kesimpulan.....	70
5.2. Saran	71

Daftar Pustaka	73
Lampiran	74

DAFTAR TABEL

Tabel 2.1 <i>Choosing Equity Coverage from Credit Rating (Multiplies of standard deviation Assumming Various Distributions)</i>	28
Tabel 2.2 <i>Comparison of Approaches to VAR</i>	32
Tabel 2.3 <i>The Relationship between the scaling factor and back test result</i>	40
Tabel 2.4 <i>Investment (Banking) book and trading book of a commercial bank</i>	44
Tabel 2.5 <i>Summary Definition Of Qualifying capital for bank Holding Companies</i> ...	49

DAFTAR GAMBAR

Gambar 2.1	Distribusi kemungkinan untung dan rugi dengan tingkat keyakinan 99%	27
Gambar 2.2	<i>Historical Simulation Method</i>	30
Gambar 2.4	<i>Acceptable loss</i>	35
Gambar 2.5	<i>Stress Testing</i>	42
Gambar 4.1	<i>Risk matrix</i>	60
Gambar 4.2	Distribusi <i>profit</i> dan <i>loss</i> metode Simulasi Historis	65

DAFTAR LAMPIRAN

- Lampiran 1: Kurs penutupan (*closing rate*) Reuters jam 16.00 WIB
- Lampiran 2: Hasil kurs penutupan (*closing rate*) Reuters jam 16.00 WIB
- Lampiran 3: Posisi terbuka masing masing-masing mata uang dan konsolidasi dalam US dollar (*Net open position*)
- Lampiran 4: *Normal profit daily* dan peringkat *profit loss* berdasarkan hasil terendah hingga tertinggi
- Lampiran 5: Perhitungan beban modal berdasarkan metode Simulasi Historis
- Lampiran 6: Distribusi portfolio *profit loss* dengan metode Simulasi Historis
- Lampiran 7: Kebutuhan modal minimum *Regulator* berdasarkan metode Simulasi Historis
- Lampiran 8: Perhitungan modal sendiri