



HALAMAN JUDUL	i
HALAMAN PENGESAHAN.....	ii
LEMBAR PERNYATAAN.....	iii
KATA PENGANTAR	iv
DAFTAR ISI	v
DAFTAR GAMBAR	viii
DAFTAR TABEL	ix
DAFTAR LAMPIRAN.....	x
INTISARI	xi
ABSTRACT	xii
 I. PENDAHULUAN.....	 1
I.1 LATAR BELAKANG	1
I.2 PERUMUSAN MASALAH	3
I.3 BATASAN MASALAH	5
I.4 TUJUAN DAN MANFAAT PENELITIAN	5
I.5 DISAIN PENELITIAN	7
I.5.1 JENIS PENELITIAN	7
I.5.2 JENIS DATA	7
I.5.3 ANALISA DATA	7
I.5.4 KERANGKA ANALISA	8
I.6 SISTEMATIKA PENULISAN	8
 II. LANDASAN TEORI	 11
II.1 DEFINISI RISIKO SUKU BUNGA POSISI BANKING BOOK	11
II.2 SUMBER-SUMBER RISIKO SUKU BUNGA	12
II.3 DAMPAK RISIKO SUKU BUNGA	16
II.3.1 EARNING PERSPECTIVE.....	17
II.3.2 ECONOMIC VALUE PERSPECTIVE	18
II.4 METODOLOGI PERHITUNGAN RISIKO SUKU BUNGA	20
II.4.1 REPRICING GAP	21

II.4.2 DURATION GAP	23
II.4.3 SIMULATION MODEL	25
II.5 METODE PERHITUNGAN YANG DIPERGUNAKAN	28
II.6 ASUMSI REPRICING UNTUK NON MATURITY ACCOUNTS.....	31
II.7 PENGUKURAN EARNING PERSPECTIVE.....	31
II.7.1 DETERMINISTIC MEASUREMENT	32
II.7.2 STOCHASTIC MEASUREMENT	32
II.8 PENGUKURAN ECONOMIC VALUE PERSPECTIVE	35
II.8.1 DETERMINISTIC MEASUREMENT	35
II.8.2 STOCHASTIC MEASUREMENT.....	36
II.9 PENGELOLAAN RISIKO SUKU BUNGA BASEL II.....	37
II.10 BEBERAPA ISSUE SEPUTAR METODE PERHITUNGAN	42
III. PROFIL PERUSAHAAN.....	45
III.1 SEJARAH SINGKAT PERUSAHAAN	45
III.2 VISI, MISI DAN STRATEGI PERUSAHAAN	50
III.3 KINERJA UMUM PERUSAHAAN	53
III.4 STRUKTUR ORGANISASI PERUSAHAAN	57
IV. METODE PENELITIAN	59
IV.1 SUMBER DATA	59
IV.2 METODE PENGUMPULAN DATA	60
IV.3 METODE ANALISIS DATA	60
V. ANALISIS DAN PEMBAHASAN	65
V.1 CAKUPAN RISIKO	65
V.2 HASIL PERHITUNGAN SIMULASI BASE SCENARIO	67
V.3 HASIL PERHITUNGAN DETERMINISTIC SCENARIO.....	68
V.4 HASIL PERHITUNGAN STOCHASTIC SCENARIO.....	70

V.5 RISIKO SUKU BUNGA EARNING PERSPECTIVE.....	72
V.5.1 DETERMINISTIC MEASUREMENT.....	72
V.5.2 STOCHASTIC MEASUREMENT.....	73
V.6 RISIKO SUKU BUNGA ECONOMIC VALUE PERSPECTIVE	74
V.6.1 DETERMINISTIC MEASUREMENT.....	74
V.6.2 STOCHASTIC MEASUREMENT.....	75
V.7 PENILAIAN KATEGORI RISIKO SUKU BUNGA BANKING BOOK POSITION	76
V.8 EVALUASI METODE PERHITUNGAN IRRBB DI BANK MANDIRI	78
V.8.1 MODEL COVERAGE	78
V.8.2 NON-MATURITY PRODUCTS	82
VI. KESIMPULAN DAN SARAN	84
VI.1 KESIMPULAN DAN KETERBATASAN PENELITIAN	84
VI.2 SARAN	88
DAFTAR PUSTAKA	90
LAMPIRAN	93