

DAFTAR ISI

	Hal
HALAMAN JUDUL.....	i
HALAMAN PENGESAHAN.....	ii
HALAMAN PERNYATAAN.....	iii
HALAMAN PERSEMBAHAN.....	iv
KATA PENGANTAR.....	v
DAFTAR ISI.....	viii
DAFTAR TABEL.....	x
DAFTAR LAMPIRAN.....	xii
INTISARI.....	xiii
ABSTRACT.....	xiv
Bab I PENDAHULUAN	
1.1. Latar Belakang	1
1.2 Perumusan Masalah.....	4
1.3 Tujuan Dan Manfaat Penelitian.....	6
1.4.Batasan Masalah.....	8
1.5. Sistematika Penulisan.....	8
Bab II TINJAUAN PUSTAKA	
2.1.Aspek Permodalan.....	10
2.2. Evolusi Manajemen Risiko.....	11
2.3. Gambaran Umum Mengenai Risiko.....	18

2.4. Metode Perhitungan Risiko.....	24
2.4.1. Risiko Kredit.....	24
2.4.2. Risiko Pasar.....	31
2.4.3. Risiko Operasional	39
Bab III METODE PENELITIAN	
3.1. Gambaran Umum PT. Bank Negara Indonesia (Persero)Tbk.....	40
3.2. Penerapan Manajemen Risiko pada PT. Bank Negara Indonesia (Persero) Tbk.....	42
3.2. Metodologi Penelitian.....	47
Bab IV HASIL DAN ANALISA	
4.1. Hasil Uji Coba Perhitungan CAR.....	52
4.2. Risiko Kredit.....	56
4.3. Risiko Pasar.....	70
4.4. Risiko Operasional.....	76
Bab. V KESIMPULAN DAN SARAN	
5.1. Kesimpulan.....	78
5.2. Saran dan Rekomendasi.....	82
DAFTAR PUSTAKA.....	85
LAMPIRAN	

DAFTAR TABEL

Tabel 2.2.1.	BaseI I vs BaseI II
Tabel 2.2.2.	Regulasi Tiga Pilar BaseI II
Tabel 2.3.1.	Road Map Implementasi BaseI II
Tabel 2.4.1.1.	Bobot Risiko Tagihan Kepada Pemerintah dan Bank Indonesia
Tabel 2.4.1.2.	Bobot Risiko Tagihan Kepada Pemerintah dan Bank dan Bank Sentral Negara Lain
Tabel 2.4.1.3.	Bobot Risiko Tagihan Kepada Entitas Sektor Publik (ESP)
Tabel 2.4.1.4.	Bobot Risiko Tagihan Bank
Tabel 2.4.1.5.	Bobot Risiko Tagihan Kepada Perusahaan
Tabel 2.4.2.1.	Bobot Perhitungan Risiko Spesifik Trading Book
Tabel 2.4.2.2.	Bobot Perhitungan Risiko Spesifik Trading Book Qualifying
Tabel 2.4.2.3.	Lembaga Pemeringkat eksternal
Tabel 2.4.2.4.	Posisi Long & Short Surat Berharga
Tabel 2.4.2.5.	Bobot Modal Pada Setiap Zona
Tabel 4.1.1.	Hasil Perhitungan Rasio CAR
Tabel 4.1.2.	Cara Perhitungan Rasio CAR
Tabel 4.2.1.	Perbandingan Pembobotan antara BaseI I & BaseI II
Tabel 4.2.2.	Perbandingan Pengenaan bobot BaseI I & BaseI II
Tabel 4.2.3.	Debitur Corporate BNI Yang telah Memiliki Peringkat
Tabel 4.2.4.	Simulasi Perhitungan rasio CAR
Tabel 4.2.5.	Eksposur Kredit Yang Memiliki Agunan C3
Tabel 4.2.6.	Simulasi Perhitungan Rasio CAR
Tabel 4.3.1.	Rincian Risiko Pasar posisi Juni 2006.
Tabel 4.3.2.	Total Risiko Spesifik Div. Tresuri & Internasional posisi Juni 2006.

- Tabel 4.3.3. Perbandingan Perhitungan Risiko Spesifik antara Basel I dan Basel II
- Tabel 4.3.4. Simulasi Perhitungan rasio CAR : *Tanpa* National Discretion dan *Dengan* National Discretion.
- Tabel 4.4.1. Perhitungan Risiko Operasional Dengan Metode Basic Indicator (BIA)

DAFTAR LAMPIRAN

- Lampiran 1. Risiko Spesifik - Eksposur Surat Berharga (Trading Book)
- Lampiran 2. Eksposur Nilai Tukar (Banking Book dan Trading Book)
- Lampiran 3. Risiko Umum - Eksposur Suku Bunga (Trading Book)
– Metode Jatuh Tempo (Maturity Method)
- Lampiran 3.a. Risiko Umum - Eksposur suku Bunga (Trading Book)
– Metode Jatuh Tempo (Maturity Method)
- Lampiran 3.b. Risiko Umum - Eksposur suku Bunga (Trading Book)
– Metode Jatuh Tempo (Maturity Method)
- Lampiran 3.c. Risiko Umum - Eksposur suku Bunga (Trading Book)
– Metode Jatuh Tempo (Maturity Method)
- Lampiran 3.d. Risiko Umum - Eksposur suku Bunga (Trading Book)
– Metode Jatuh Tempo (Maturity Method)