

DAFTAR ISI

| | |
|--|-----------|
| HALAMAN JUDUL | i |
| HALAMAN PENGESAHAN | ii |
| HALAMAN PERNYATAAN | iii |
| KATA PENGANTAR | iv |
| DAFTAR ISI..... | vi |
| DAFTAR TABEL..... | ix |
| DAFTAR GAMBAR | x |
| DAFTAR LAMPIRAN..... | xi |
| ABSTRAK | xii |
| ABSTRACT..... | xiii |
| BAB I PENDAHULUAN..... | 1 |
| 1.1. Latar Belakang | 1 |
| 1.2. Rumusan Masalah..... | 5 |
| 1.3. Pertanyaan Penelitian..... | 6 |
| 1.4. Tujuan Penelitian | 6 |
| 1.5. Manfaat Penelitian | 7 |
| 1.6. Lingkup Penelitian | 7 |
| 1.7. Sistematika Penulisan | 8 |
| BAB II LANDASAN TEORI | 10 |
| 2.1. Landasan Teori..... | 10 |
| 2.1.1. Risiko Operasional..... | 10 |
| 2.1.2. Sumber-Sumber Risiko Operasional..... | 12 |

| | | |
|--|---|-----------|
| 2.1.3. | Identifikasi Risiko Operasional..... | 15 |
| 2.1.4. | Pengukuran Risiko Operasional..... | 16 |
| 2.1.4.1. | <i>Basic Indicator Approach (BIA)</i> | 17 |
| 2.1.4.2. | <i>Standardised Approach (SA)</i> | 18 |
| 2.1.4.3. | <i>Advanced Measurement Approaches (AMA)</i> | 19 |
| 2.1.5. | Pengukuran Risiko dengan VaR dan <i>Extreme Value Theory</i> (EVT) | 20 |
| 2.1.5.1. | Pengertian VaR dan EVT..... | 20 |
| 2.1.5.2. | Penetapan <i>Threshold</i> | 23 |
| 2.1.5.3. | Estimasi Parameter EVT | 24 |
| 2.1.5.4. | Distribusi <i>Peak Over Threshold-Generalized Pareto Distribution</i> | 25 |
| 2.1.6. | Pengukuran Risiko Operasional dengan Metode <i>Internal Model</i> | 26 |
| 2.1.7. | Perbandingan Metode <i>Extreme Value Theory</i> dan <i>Internal Model</i> | 27 |
| 2.2. | Kajian Penelitian Terdahulu | 28 |
| 2.3. | Kerangka Penelitian | 29 |
| BAB III METODE PENELITIAN | | 31 |
| 3.1. | Desain Penelitian | 31 |
| 3.2. | Metode Pengumpulan Data..... | 31 |
| 3.3. | Instrumen Penelitian | 32 |
| 3.4. | Metode Analisis Data..... | 33 |
| 3.4.1. | Mengumpulkan Data Kerugian (<i>Loss Event Database</i>) | 33 |
| 3.4.2. | Pemetaan Data | 34 |

| | | |
|----------------------------------|--|-----------|
| 3.4.3. | Menganalisis Data..... | 34 |
| 3.4.3.1. | Mengidentifikasi <i>Threshold</i> dan Data Ekstrem | 34 |
| 3.4.3.2. | Menetapkan Estimasi Parameter EVT | 34 |
| 3.4.3.3. | Menghitung OpsVaR Tiap-tiap <i>Loss Event Type</i> | 36 |
| 3.4.3.4. | Perhitungan Risiko Operasional Perusahaan dengan Metode <i>Internal Model</i> | 37 |
| 3.5. | Profil Kasus..... | 37 |
| BAB IV ANALISIS DATA..... | | 41 |
| 4.1. | Pengumpulan Data | 41 |
| 4.2. | Pemetaan Data | 41 |
| 4.3. | Menganalisis Data..... | 45 |
| 4.3.1. | Mengidentifikasi <i>Threshold</i> dan Data ekstrem | 45 |
| 4.3.2. | Menetapkan Estimasi Parameter EVT | 46 |
| 4.3.3. | Menghitung OpsVar Tiap-tiap <i>Loss Event Type</i> | 48 |
| 4.3.4. | Perhitungan Risiko Operasional Perusahaan dengan Metode <i>Internal Model</i> | 51 |
| BAB V SIMPULAN | | 53 |
| 5.1. | Simpulan | 53 |
| 5.2. | Implikasi | 54 |
| 5.3. | Keterbatasan..... | 54 |
| 5.4. | Saran | 55 |
| DAFTAR PUSTAKA | | 56 |