

DAFTAR ISI

LEMBAR PENGESAHAN.....	I
LEMBAR KEASLIAN.....	II
PERNYATAAN PERSETUJUAN PUBLIKASI.....	III
KATA PENGANTAR.....	IV
ABSTRAK.....	VI
DAFTAR ISI.....	VII
DAFTAR TABEL.....	IX
DAFTAR GAMBAR.....	X
BAB I PENDAHULUAN	
1.1 Latar Belakang.....	1
1.2 Rumusan Masalah.....	4
1.3 Tujuan Penelitian.....	4
1.4 Manfaat Penelitian.....	5
1.5 Lingkup dan Batasan Penelitian.....	5
1.6 Sistematika Penulisan.....	5
BAB II KAJIAN TEORI	
2.1 Risiko dan Manajemen Risiko.....	7
2.2 Manajemen Risiko Terintegrasi.....	7
2.3 Kerangka Manajemen Risiko.....	9
2.4 Proses Pengelolaan Risiko.....	10
2.5 Proses Manajemen Risiko.....	11
2.6 Klasifikasi Manajemen Risiko.....	14
2.7 <i>Stress Test</i>	16
2.8 Monte Carlo.....	18
BAB III METODE PENELITIAN	
3.1 Kerangka Analisis.....	20
3.2 Jenis Penelitian.....	21
3.3 Metode Penelitian.....	21

3.4 Proses Pengumpulan Data.....	24
3.5 Proses Analisis Data.....	25
BAB IV PROFIL PERUSAHAAN	
4.1 Profil Perusahaan.....	28
4.2 Manajemen Risiko Terintegrasi PT XYZ.....	30
4.3 Struktur Organisasi PT XYZ.....	42
BAB V EVALUASI KINERJA KEUANGAN PERUSAHAAN ATAS <i>STRESS TESTING</i>	
5.1 Analisis <i>Stress Test</i>	43
5.2 Analisis <i>Forecasting</i>	48
BAB VI EVALUASI LIMIT RISIKO ATAS <i>STRESS TESTING</i>	
6.1 Evaluasi Asesmen Risiko PT XYZ.....	51
6.2 Evaluasi <i>Risk Appetite & Risk Tolerance</i> PT XYZ.....	55
6.3 Pemetaan Risiko PT XYZ.....	63
BAB VII RENCANA PENERAPAN MANAJEMEN RISIKO ATAS <i>STRESS TESTING</i>	
7.1 Evaluasi Risiko.....	64
7.2 Penanganan Risiko.....	63
7.3 Peta Risiko Setelah Mitigasi Risiko.....	69
7.4 Implementasi Manajemen Risiko.....	70
BAB VIII KESIMPULAN DAN SARAN	
8.1 Kesimpulan.....	81
8.2 Saran.....	82
DAFTAR PUSTAKA.....	83
LAMPIRAN	

DAFTAR TABEL

2.1 Matriks Probabilitas Risiko.....	13
2.2 Skala Dampak Risiko.....	13
3.1 Kebutuhan Data.....	23
4.1 Kriteria Dampak Risiko PT XYZ.....	34
4.2 Tabel Frekuensi Risiko PT XYZ.....	35
4.3 <i>Asessment Risk</i> PT XYZ.....	36
4.4 Pembobotan Risiko PT XYZ.....	38
4.5 Profil Risiko PT XYZ.....	37
4.6 <i>Risk Appetite</i> dan <i>Risk Tolerance</i> PT XYZ.....	40
4.7 <i>Inheren Risk</i> PT XYZ.....	41
5.1 <i>Stress Test</i> Risiko Kredit, Pasar, dan Likuiditas.....	45
6.1 <i>Inheren Risk</i> Saat Sebelum dan Sesudah <i>Stress Testing</i>	52
6.2 Profil Risiko Sebelum <i>Stress Testing</i>	54
6.3 Profil Risiko Setelah <i>Stress Testing</i>	55
6.4 <i>Risk Appetite</i> dan <i>Risk Tolerance</i> Sebelum <i>Stress Testing</i>	56
6.5 <i>Risk Appetite</i> dan <i>Risk Tolerance</i> Saat <i>Stress Testing</i>	57
6.6 <i>Asessment Risk</i> Sebelum Terjadinya <i>Stress Testing</i>	59
6.7 <i>Asessment Risk</i> Saat Terjadinya <i>Stress Testing</i>	61
7.1 Daftar Risiko Diluar Batas Toleransi.....	64
7.2 <i>Risk Register</i>	68
7.4 Rencana Implementasi Manajemen Risiko PT XYZ.....	71
7.5 Tabel RACI Manajemen Risiko PT XYZ.....	72
7.6.1 Proses Profil Worksheet Aktivitas 1.....	73
7.6.2 Proses Profil Worksheet Aktivitas 2.....	74
7.6.3 Proses Profil Worksheet Aktivitas 3.....	75
7.6.4 Proses Profil Worksheet Aktivitas 4.....	76
7.6.5 Proses Profil Worksheet Aktivitas 5.....	77
7.6.6 Proses Profil Worksheet Aktivitas 6.....	78
7.6.7 Proses Profil Worksheet Aktivitas 7.....	79
7.6.8 Proses Profil Worksheet Aktivitas 8.....	80

DAFTAR GAMBAR

2.1 Kerangka Manajemen Risiko ISO 31000.....	9
2.2 Proses Manajemen Risiko.....	11
2.3 Diagram Pemetaan Risiko.....	14
2.4 Peta Risiko.....	14
2.5 VaR Framework.....	16
2.6 Alokasi dan Verifikasi Modal.....	17
2.7 Formulasi Uji Skenario.....	18
3.1 Kerangka Analisis Penelitian.....	20
4.1 Susunan Organisasi Manajemen Risiko PT XYZ.....	34
4.2 Peta Risiko PT XYZ Tahun 2016.....	39
4.3 Struktur organisasi PT XYZ.....	42
5.1 Perubahan <i>Market Value of Equity</i>	47
5.2 Perubahan CoD Sebelum dan Saat <i>Stress Test</i>	47
5.3 Perubahan <i>Market Value of Equity</i> Sebelum dan Saat <i>Stress Test</i>	47
5.4 <i>Forecasting Revenue</i>	49
5.5 Perbandingan CoD Optimum dan <i>Forecasting CoD</i>	50
5.6 Perkiraan CoD saat <i>Forecasting</i> 5 Tahun.....	50
6.1 Peta Risiko PT XYZ Saat Kondisi Stabil.....	58
6.2 Peta Risiko PT XYZ Sebelum <i>Stress Testing</i>	63
6.3 Peta Risiko PT XYZ Saat <i>Stress Testing</i>	63
7.1 Peta Risiko PT XYZ Sebelum <i>Stress Testing</i>	69
7.2 Peta Risiko PT XYZ Saat <i>Stress Testing</i>	69
7.3 Peta Risiko PT XYZ Setelah Dilakukan Mitigasi.....	70