

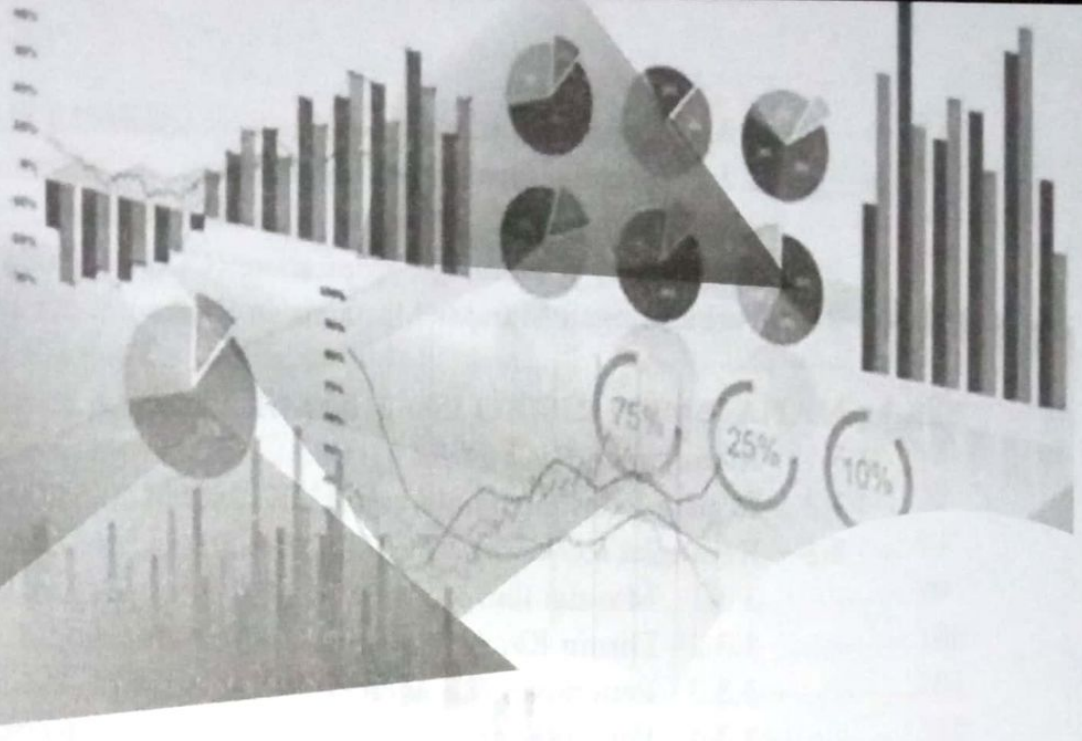
MANAJEMEN RISIKO PASAR MODAL (ISO 31000: 2018)

Edisi 2

Dr. Embun Prowanta, MM, CSA[®], CRP[®], CFP[®]

		PERPUSTAKAAN	
No. INV.			
Th. Angg.		Cat	
PARAP.		TGL.	





Daftar Isi

Kata Pengantar	v
Daftar Isi	vii
Bab 1 RISIKO DAN MANAJEMEN RISIKO	1
1.1 Risiko	1
1.2 Manajemen Risiko	5
1.2.1 Prinsip-Prinsip Manajemen Risiko	12
1.2.2 Manfaat Manajemen Risiko	15
1.3. Proses Manajemen Risiko.....	16
1.4 Manajemen Risiko Tradisional dan Perusahaan	17
1.5 Budaya Risiko	20
Bab 2 STANDAR MANAJEMEN RISIKO	25
2.1 Standar Manajemen Risiko	25
2.2 Australia Standard/New Zealand Standard (AS/NZS 4360:2004) ..	27
2.2.1. Komunikasi dan Konsultasi	29
2.2.2 Menetapkan Konteks	29
2.2.3 Identifikasi Risiko	31
2.2.4 Analisis Risiko.....	31
2.2.5 Evaluasi Risiko	34

2.2.6	Perlakuan Risiko.....	34
2.2.7	Menilai Opsi Perlakuan Risiko.....	36
2.2.8	Menyiapkan Rencana Perlakuan Risiko.....	37
2.3	<i>Committee of Sponsoring Organizations (COSO) : 2004</i>	38
2.4	Perbandingan Standar Manajemen Risiko.....	40
Bab 3	MANAJEMEN RISIKO ISO 31000	43
3.1	Manajemen Risiko ISO 31000	43
3.2	Prinsip-Prinsip Manajemen Risiko ISO 31000: 2009	46
3.3	Kerangka Kerja	47
3.3.1	Mandat dan Komitmen.....	50
3.3.2	Disain Kerangka Kerja Untuk Mengelola Risiko.....	50
3.3.3	Penerapan Manajemen Risiko	54
3.3.4	Pemantauan dan Kaji Ulang Kerangka Kerja.....	54
3.3.5	Perbaikan Berkelanjutan Kerangka Kerja.....	54
3.4	Proses Manajemen Risiko ISO 31000	55
3.4.1	Menetapkan Konteks	56
3.4.2	Identifikasi risiko	60
3.4.3	Analisis Risiko	60
3.4.4	Evaluasi Risiko	62
3.4.5	Perlakuan Risiko	64
3.4.6	Komunikasi dan Konsultasi	69
3.4.7	Pemantauan & Pengkajian Ulang.	70
Bab 4	ISO 31000: 2018	73
4.1	Pendahuluan	73
4.2	Prinsip-Prinsip Manajemen Risiko	75
4.3	Kerangka Kerja	77
4.3.1	Kepemimpinan dan komitmen	78
4.3.2	Integrasi	79
4.3.3	Desain.....	80
4.3.4	Implementasi.....	81
4.3.5	Evaluasi	82
4.3.6	Perbaikan Berkelanjutan	82
4.4	Proses Manajemen Risiko	82
4.4.1	Komunikasi dan konsultasi	83
4.4.2	Ruang lingkup, konteks dan kriteria.....	84
4.4.3	Penilaian risiko	85
4.4.4	Perlakuan berisiko	87
4.4.5	Pemantauan dan peninjauan ulang.....	88
4.4.6	Pencatatan dan pelaporan	89

Bab 5	PENILAIAN RISIKO.....	91
5.1.	<i>Brainstorming</i>	92
5.2.	Wawancara terstruktur atau semi-terstruktur	93
5.3.	Teknik Delphi	93
5.4.	<i>Check-List</i>	94
5.5.	Matriks Konsekuensi/Probabilitas	94
5.6	<i>Cost-Benefit Analysis</i> (CBA)	95
5.7.	<i>Scenario Analysis</i>	95
5.8.	<i>Business impact analysis</i> (BIA)	97
5.9.	<i>Root cause analysis</i> (RCA)	97
5.10	<i>Fault Tree Analysis</i> (FTA)	99
5.11.	<i>Event Tree Analysis</i> (ETA)	100
5.12.	<i>Cause-and-Effect Analysis</i>	101
5.13	<i>Decision Tree Analysis</i>	102
5.14	<i>Bow Tie Analysis</i>	102
5.15.	Simulasi Monte Carlo	103
5.16	Statistik Bayesian dan <i>Bayes Nets</i>	104
5.17.	Indeks Risiko	105
Bab 6	MANAJEMEN RISIKO PASAR MODAL.....	107
6.1.	Manajemen Risiko Industri Pasar Modal	107
6.2.	Penerapan Manajemen Risiko Pasar Modal	110
6.2.1.	Regulator.....	110
6.2.2.	<i>Self-Regulation Organization</i> (SRO)	112
6.2.3.	Emiten	113
6.2.4.	Perantara Pedagang	115
6.3	Kejadian Risiko di Pasar Modal.....	118
6.4	Risiko Investasi Saham.....	120
6.5	Register Risiko	122
6.5.1	Perusahaan Sekuritas	122
6.5.2	Manajer Investasi.....	124
Bab 7	AUDIT INTERNAL BERBASIS RISIKO	129
7.1	Pendahuluan	129
7.2	Tahapan melaksanakan RBIA	133
	ISTILAH DAN DEFINISI MANAJEMEN RISIKO.....	147
	DAFTAR PUSTAKA	153