

SEKOLAH TINGGI ILMU EKONOMI (STIE) LABUHANBATU

GARIS-GARIS BESAR PROGRAM PENGAJARAN (GBPP)

Judul Mata Kuliah : **Manajemen Resiko**

Kode/ SKS : MKPB 503 / 3 SKS

Deskripsi Singkat : Mata kuliah ini membahas resiko bank dan institusi keuangan lainnya (market risk dan credit risk), namun demikian materi ini sama pentingnya untuk institusi non keuangan.

Tujuan Instruksional Umum : Mahasiswa dapat memahami dan mampu menganalisis berbagai resiko (bank dan institusi keuangan) dan institusi non keuangan.

Pertemuan	Tujuan Instruksional Khusus	Pokok Bahasan	Sub Pokok Bahasan	Estimasi Waktu	Daftar Pustaka
1	2	3	4	5	6
I	Mahasiswa memahami dan mengerti tentang risiko-return trade-off dipandang dari sudut investor maupun perusahaan serta beberapa pendekatan dalam manajemen resiko.	Pendahuluan.	<ol style="list-style-type: none"> 1. Risk vs Return bagi investor 2. Risk vs Return bagi perusahaan 3. Bank capital 4. Beberapa pendekatan dalam manage resiko. 	150 menit	John, C Hull: 2007, Risk Management and Financial Institution, Pearson international edition Inc, New Jersey. Chapter 1
II	Mahasiswa dapat memahami dan mengetahui produk-produk keuangan dan hedging (pengalihan resiko).	Produk-produk keuangan dan pengalihan resiko (hedging).	<ol style="list-style-type: none"> 1. Short sales, forward contracts, future contracts, SWAPs, dan option. 2. Hedging (pengalihan resiko). 	150 menit	John, C Hull: 2007, Risk Management and Financial Institution, Pearson international edition Inc, New Jersey. Chapter 1 dan 2
Pertemuan	Tujuan Instruksional Khusus	Pokok Bahasan	Sub Pokok Bahasan	Estimasi Waktu	Daftar Pustaka
1	2	3	4	5	6

III	Mahasiswa memahami dan mengerti bagaimana mengukur interest rate sebagai cerminan resiko.	Resiko suku bunga	<ol style="list-style-type: none"> 1. Mengukur interest rate. 2. Treasury rates, LIBOR, SWAp rates, Duration, convexity. 	150 menit	John, C Hull: 2007, Risk Management ang Financial Institution, Pearson international edition Inc, New Jersey. Chapter 4
IV	Mahasiswa memahami dan mengerti bagaimana menganalisis volatility berdasarkan data historis.	Volatility	<ol style="list-style-type: none"> 1. Definisi volatility 2. Estimasi volatility dengan data historis 3. Monitoring daily volatility serta modelmodelnya. 	150 menit	John, C Hull: 2007, Risk Management ang Financial Institution, Pearson international edition Inc, New Jersey. Chapter 5
V	Untuk mengetahui sejauh mana mahasiswa memahami materi minggu ke 1 s/d 4.	Tugas membuat makalah untuk didiskusikan dari kasus-kasus yang ada pada bab 1 s/d 5.		150 menit	John, C Hull: 2007, Risk Management ang Financial Institution, Pearson international edition Inc, New Jersey. Chapter 1, 2, 4, dan 5
VI	Mahasiswa dapat memahami dan mengerti konsep market risk dengan pendekatan historical simulation.	Market risk.	<ol style="list-style-type: none"> 1. Metodologi 2. Akurasi 3. Perluasan 4. Teori nilai ekstrim. 	150 menit	John, C Hull: 2007, Risk Management ang Financial Institution, Pearson international edition Inc, New Jersey. Chapter 9.

Pertemuan	Tujuan Instruksional Khusus	Pokok Bahasan	Sub Pokok Bahasan	Estimasi Waktu	Daftar Pustaka
1	2	3	4	5	6

VII	Mahasiswa dapat memahami dan mengerti konsep market risk dengan pendekatan model-building.	Market risk.	1. Metodologi 2. Model linier 3. Aplikasi model linier 4. Kasus.	150 menit	John, C Hull: 2007, Risk Management and Financial Institution, Pearson international edition Inc, New Jersey. Chapter 10
VIII		Ujian Tengah Semester (UTS)	Minggu 1 sampai dengan minggu ke 7	120 menit	
IX	Mahasiswa dapat memahami dan mengerti tentang resiko kredit serta bagaimana mengestimasi kemungkinan default.	Credit risk.	1. Peringkat kredit 2. Tingkat pemulihan 3. Estimasi kemungkinan default harga obligasi 4. Kasus.	150 menit	John, C Hull: 2007, Risk Management and Financial Institution, Pearson international edition Inc, New Jersey. Chapter 11
X	Mahasiswa dapat memahami dan mengerti tentang credit risk losses.	Credit Risk Losses.	1. Estimasi credit losses 2. Mengurangi resiko kredit 3. Kasus .	150 menit	John, C Hull: 2007, Risk Management and Financial Institution, Pearson international edition Inc, New Jersey. Chapter 12
XI	Mahasiswa dapat mengidentifikasi dan memahami derivasi kredit.	Credit Derivatives.	1. Credit default swaps 2. Valuation of credit default swaps 3. Kasus .	150 menit	John, C Hull: 2007, Risk Management and Financial Institution, Pearson international edition Inc, New Jersey. Chapter 13

Pertemuan	Tujuan Instruksional Khusus	Pokok Bahasan	Sub Pokok Bahasan	Estimasi Waktu	Daftar Pustaka
1	2	3	4	5	6

XII	Mahasiswa dapat memahami dan mengerti resiko operasional serta mampu menganalisanya.	Operational Risk.	<ol style="list-style-type: none"> 1. Pengertian resiko operasional 2. Pengkategorian resiko operasional 3. Alokasi resiko operasional 4. Asuransi 5. Kasus 	150 menit	John, C Hull: 2007, Risk Management ang Financial Institution, Pearson international edition Inc, New Jersey. Chapter 14
XIII	Untuk mengetahui sejauh mana mahasiswa dapat memahami materi minggu 1 s/d 9.	Tugas membuat makalah untuk didiskusikan dari kasus-kasus bab 9 s/d 12.		150 menit	John, C Hull: 2007, Risk Management ang Financial Institution, Pearson international edition Inc, New Jersey. Chapter 9, 10, 11, dan 12.
XIV	Mahasiswa memahami model-model resiko dan resiko likuiditas.	Model Risk dan Liquidity Risk.	<ol style="list-style-type: none"> 1. Model non linier produk 2. Model struktur produk 3. Manajemen modal jangka panjang. 4. Likuiditas vs profitabilitas 5. Kasus 	150 menit	John, C Hull: 2007, Risk Management ang Financial Institution, Pearson international edition Inc, New Jersey. Chapter 15
XV	Mahasiswa dapat memahami dan mengerti konsep economic capital dan Risk Adjusted Return On Capital (RAROC).	Economic Capital and RAROC	<ol style="list-style-type: none"> 1. Definisi economic capital 2. Komponen economic capital 3. Agregasi economic capital 4. RAROC 5. Kasus 	120 menit	John, C Hull: 2007, Risk Management ang Financial Institution, Pearson international edition Inc, New Jersey. Chapter 16 dan 17
XVI		Ujian Akhir Semester (UAS)	Minggu ke 9 sampai dengan minggu ke 15	120 menit	