

DAFTAR ISI

BAB	Uraian	Halaman
I	PENDAHULUAN	1
II	PENGUNAAN METODE STANDAR DALAM PERHITUNGAN KPMM DENGAN MEMPERHITUNGKAN RISIKO PASAR	2
	1. Umum	2
	2. Perhitungan Risiko Suku Bunga	2
	a. Ketentuan Umum	2
	b. Perhitungan Risiko Spesifik	3
	c. Perhitungan Risiko Umum	7
	d. Proses saling hapus untuk transaksi derivatif dalam perhitungan Risiko Spesifik dan Risiko Umum	14
	e. Perlakuan terhadap Transaksi <i>Repo</i>	15
	f. Perlakuan terhadap Transaksi <i>Reverse Repo</i> dalam rangka kegiatan perdagangan (<i>trading</i>)	16
	g. Perlakuan terhadap Transaksi Reksadana	16
	h. Perlakuan terhadap Derivatif Kredit (<i>Credit Derivatives</i>)	18
	3. Perhitungan Risiko Nilai Tukar	26
	4. Perhitungan Risiko Ekuitas	27
	5. Perhitungan Risiko Komoditas	30

6.	Pedoman Umum dan Perhitungan Risiko Pasar terhadap Transaksi <i>Option</i>	34
a.	Ketentuan Umum	34
b.	Metode Sederhana (<i>Simplified Approach</i>)	34
c.	Pendekatan <i>Intermediate</i> (<i>Intermediate Approach</i>)	36
III	PERHITUNGAN KEWAJIBAN PENYEDIAAN MODAL MINIMUM (KPMM)	46