

ABSTRAKSI

PT. Alam Semesta merupakan perusahaan yang bergerak dalam bidang ekspor-impor ikan hias. Dalam pelaksanaan kegiatan operasionalnya, perusahaan tersebut memiliki risiko operasional yang memiliki probabilitas yang besar, karena semua risiko operasional yang teridentifikasi memiliki probabilitas diatas 20%. Menurut Ronny Kountur dalam bukunya yang berjudul mudah memahami manajemen risiko perusahaan, disebutkan bahwa umumnya risiko-risiko operasional yang probabilitas terjadinya 20% atau lebih besar dianggap sebagai kemungkinan besar.

Pengukuran probabilitas risiko dilakukan melalui uji disitribusi data terlebih dahulu untuk mengetahui karakteristik data masing-masing risiko operasional. dari hasil uji distribusi data tersebut, diperoleh bahwa risiko kematian ikan hias dan risiko ikan hias sakit mengikuti distribusi normal, sementara risiko kerusakan barang pada bagian persediaan, risiko kerusakan barang pada bagian pengendalian ikan, risiko kesalahan administrasi pada bagian administrasi dan umum, dan risiko kesalahan administrasi pada bagian keuangan mengikuti disitribusi poisson.

Pengukuran dampak risiko dilakukan dengan metode VaR (Value at Risk) melalui simulasi monte carlo dengan membangkitkan bilangan acak sebanyak 100, 1000, dan 1000 kali. Dari hasil pengukuran, diperoleh selisih antara hasil simulasi dengan data histori sebesar 0,89% untuk risiko kesalahan administrasi bagian keuangan, 1,16% untuk risiko kesalahan administrasi bagian administrasi dan umum, 4,26 % untuk risiko kerusakan barang bagian pengendalian ikan, 0,18% untuk risiko kerusakan barang bagian persediaan, 0,307% untuk risiko ikan hias sakit, 0,05 % untuk risiko kematian ikan hias.

Untuk menekan probabilitas risiko operasional dan dampak yang ditimbulkan, dilakukan peningkatan kualitas SDM, memberikan sangsi dan reward, dan penambahan peralatan kerja dengan menyediakan biaya sebesar Rp. 6.970.000,00 per tahun atau Rp. 580.833,33 per bulan untuk membiayai penanganan risiko operasional yang dilakukan.

Kata kunci : risiko operasional, distribusi normal, distribusi poisson, monte carlo, VaR.