

Analisis Portofolio Mata Uang Asing dengan Metode Value At Risk Periode 1 September 2006-31 Agustus 2009: Studi Kasus PT. Bank EOS

Tambunan, Narsillam, author

Deskripsi Lengkap: <https://lib.ui.ac.id/detail?id=136276&lokasi=lokal>

Abstrak

Perhitungan VaR (Value at Risk) merupakan kewajiban bagi setiap bank dalam mengukur potensi risiko atas portfolio yang dimilikinya. Ini merupakan kewajiban yang diamanatkan oleh Bank Indonesia (BI). Pada Tesis ini, akan diperlihatkan pengukuran VaR risiko nilai tukar pada PT Bank EOS dan pendekatan estimasi volatilitas EWMA serta ARCH/GARCH. Diperlihatkan bahwa ARCH/GARCH dapat menghasilkan model VaR yang lebih baik daripada model VaR yang menggunakan estimasi volatilitas EWMA. Dengan menggunakan ARCH/GARCH, maka kita akan memperoleh nilai VaR Portfolio PT. Bank EOS untuk 1 September 2009 sebesar Rp. 3.783.429.678.

<hr><i>Bank has a responsibility to assess potential risk of its portfolio through VaR (Value at Risk). VaR is a mandatory assessment required by Central Bank of Indonesia (BI). This thesis will illustrate how to make an assessment about potential risk of foreign exchange portfolio of PT Bank EOS by evaluating VaR with both EWMA and ARCH/GARCH methods. Final result described that ARCH/GARCH methods is better than EWMA. By using ARCH/GARCH, VaR for PT Bank EOS on the 1st of September 2009 is Rp. 3.783.429.678.</i>