

Analisis transaksi pasar uang dengan metode value at risk (studi kasus: Money market dan spot market dealing room BRI)

Andarini, author

Deskripsi Lengkap: <https://lib.ui.ac.id/detail?id=93783&lokasi=lokal>

Abstrak

Karya Akhir ini ditulis beranjak dari permasalahan bahwa faktor ketidakpastian nilai tukar dan tingkat suku bunga menimbulkan risiko bisnis yang cukup tinggi pada transaksi yang dilakukan oleh Dealing Room, Banyak fakta mengungkapkan bahwa tidak sedikit bank yang collaps akibat transaksi yang dilaksanakan oleh Dealing Room. Untuk itu dibutuhkan suatu penghitungan risiko agar dapat mengantisipasi kerugian buruk yang mungkin terjadi. Salah satu metode yang digunakan untuk risiko adalah dengan Value at Risk (VaR).

Tujuan dan penulisan ini adalah menghitung risiko atas 5 transaksi yang dilakukan Dealing Room BRL yaitu transaksi spot US Dollar terhadap rupiah, Call money Rupiah dan Call Money US Dollar dengan jangh waktu avemight dan satu minggu, menghitung dana penyangga yang dibutuhkan untuk dapat mengcover risiko yang ditimbulkan (Capital at Risk =CaR) yang dilanjutkan dengan penghitungan pengaruh terhadap CAR (Capital Adequacy Ratio) serta menentukan strategi yang dapat dilakukan atas hasil VaR dan Ca.R yang diperoleh.