

## Pengukuran value at risk risiko nilai tukar dengan estimasi volatilitas ewma dan archigarch (studi kasus pt bank fdr)

Silitonga, Yerry Patumona, author

Deskripsi Lengkap: <https://lib.ui.ac.id/detail?id=119989&lokasi=lokal>

---

### Abstrak

Pengukuran risiko merupakan salah satu aktifitas manajemen risiko yang telah dilakukan oleh banyak bank pada masa ini. Kesulitan yang dialami PT. Bank FDR dalam melakukan perhitungan nilai VaR (Value at Risk) pada risiko nilai tukar juga merupakan permasalahan yang dapat dialami oleh bank-bank lain di Indonesia. Pada karya akhir ini akan diperlihatkan pengukuran VaR risiko nilai tukar dan digunakan 2 pendekatan estimasi volatilitas yaitu EWMA dan ARCH/GARCH. Pada Karya Akhir ini diperlihatkan bahwa ARCH/GARCH dapat menghasilkan model VaR yang lebih baik daripada model VaR yang menggunakan estimasi volatilitas EWMA. Dengan menggunakan ARCH/GARCH, maka diperoleh nilai VaR Portfolio PT. Bank FDR untuk 1 Februari 2007 sebesar Rp. 77.307.209,00.

<hr>

Measuring risks is one of risk management activities which have been largely implemented by many banks on this era. The problem in PT. Bank FDR on calculating Value at Risk (VaR) on foreign exchange risk is possibly a common problem which faced by other banks in Indonesia. In this thesis was described ARCH/GARCH will result better VaR model than EWMA. By applying ARCH/GARCH, it's resulted VaR on PT. Bank FDR for 1st of February 2007 as much as Rp. 77.307.209,00.