

Pengukuran risiko pasar portofolio surat utang negara trading (studi kasus bank xyz) = Market risk measurement of government bonds Portfolio (case study of bank xyz)

Toga Ari Wibowo, author

Deskripsi Lengkap: <https://lib.ui.ac.id/detail?id=120773&lokasi=lokal>

Abstrak

Tesis ini membahas pengukuran risiko pasar atas investasi portofolio Surat Utang Negara (SUN).

Pengukuran tersebut dapat berguna sebagai bahan pertimbangan trade off antara return dan risiko atas dana yang dihimpun dari masyarakat. Manfaat lainnya adalah sebagai dasar perhitungan jumlah modal minimum yang harus dimiliki bank untuk memproteksi kerugian akibat volatilitas pasar dari investasi SUN tersebut.

Tujuan dari penelitian ini adalah untuk mengukur dan membandingkan dua metode pengukuran atas risiko pasar SUN dan mengkaji implikasi (efektifitas dan efisiensi) dari kedua pendekatan tersebut terhadap capital charges dan efeknya bagi kinerja keuangan.

Metode yang digunakan adalah pendekatan standardized model dan pendekatan internal model (Value at Risk).

Dari hasil yang telah diperoleh maka dapat disimpulkan bahwa pengukuran risiko pasar atas portofolio SUN trading Bank XYZ dengan pendekatan VaR menghasilkan angka yang lebih akurat dibandingkan pendekatan standar sehingga alokasi modal menjadi jauh lebih efektif.

<hr>

This thesis explains about market risk measurement of government bonds portfolio. It uses as judgment for valuing trade off between risk and return from funding investment. In addition, it is useful for calculating minimum capital requirement to protect bank from losing caused by market volatility.

The purpose of this research is to measure and compare two measurement methodology of goverment bonds market risk and analyze implication (effectivity and efficiency) those two approach regarding capital charges and the effect for financial performance.

The two methods used, are standardized model and internal model (Value at Risk).

From the result of this research, the conclusion is market risk measurement of goverment bonds using VaR shows more accurate than standar approach so capital allocation will be more effective.