

Pengukuran resiko pasar portofolio obligasi surat utang negara seri benchmark pada Bank XXX = Government benchmark bonds portfolio market risk measurement in Bank XXX

M. Arief Amruzar, author

Deskripsi Lengkap: <https://lib.ui.ac.id/detail?id=20455843&lokasi=lokal>

Abstrak

ABSTRAK

Penelitian membahas pengukuran resiko dari portofolio obligasi seri benchmark yang dimiliki oleh Bank XXX. Periode penilaian resiko antara tanggal 1 Januari 2014 samapai dengan 31 Desember 2016.

Pengukuran resiko menggunakan metode Expected Shortfall dan model volatilitas GJR GARCH terhadap return obligasi seri benchmark yang dimiliki oleh bank XXX. Hasil analisis menunjukkan bahwa pada tingkat kepercayaan sebesar 99 obligasi negara dengan tenor 10 tahun memiliki faktor resiko paling rendah dibanding seri benchmark lain. Sehingga lebih aman bagi bank XXX untuk memiliki obligasi Surat Utang Negara tersebut dengan jumlah yang lebih besar dibandingkan obligasi benchmark tenor lainnya.

<hr>

ABSTRACT

This thesis describe benchmark bonds portfolio market risk owned by bank XXX. Time period of this thesis in between January 1st 2014 to December 31 2016. Risk measurement using Expected Shortfall method and GJR GARCH volatility model against bechmark bonds. Result of analysis in 99 confidence level shows 10 year benchmark bonds has lower risk than other benchmark bonds. It is safer to bank XXX to have more 10 year benchmark bond in it s portfolio .