

Pengukuran risiko nilai tukar dengan value at risk untuk meminimalisasi loss forex trading pada bank sumsel babel periode 2016/2017 =
Measurement of exchange rate risk with value at risk to minimize forex trading losses in bank sumsel babel period 2016/2017

Ira Muzdhalifah, author

Deskripsi Lengkap: <https://lib.ui.ac.id/detail?id=20477307&lokasi=lokal>

Abstrak

Tujuan dari penelitian ini adalah mengukur exchange rate risk pada portofolio foreign exchange di Bank Sumsel Babel dengan Value at Risk dan perhitungan VaR ini dapat membuat pengukuran risiko dan pemantauan risiko menjadi lebih efisien. Pengukuran risiko menggunakan metode internal/VaR ini akan sesuai dengan tingkat risiko yang akan ditanggung akibat nilai tukar yang dimiliki bank. Data yang digunakan pada penelitian studi kasus ini adalah data historis harian kurs selama 2 dua tahun, yaitu tanggal 04 Januari 2016 sampai dengan tanggal 30 Desember 2017 dengan total jumlah pengamatan sebanyak 488 pengamatan. Nilai tukar yang digunakan adalah kurs tengah selama hari kerja trading days yang dipublikasikan oleh Bank Indonesia. Mata uang asing yang digunakan sesuai dengan portofolio mata uang asing di Bank Sumsel Babel dan Metode perhitungan VaR yang digunakan adalah dengan menggunakan model GARCH.

.....The purpose of this research is to measure exchange rate risk on foreign exchange portfolio at Bank Sumsel Babel with Value at Risk and calculation of VaR can make risk measurement and risk monitoring more efficient. Measurement of risk using internal VaR method will be in accordance with the level of risk that will be borne by the exchange rate owned by the bank. The data used in this case study is daily historical data for 2 two years, ie, January 04, 2016 until December 30, 2017, with a total of 488 observations. The exchange rate used is the middle rate during the business day trading days published by Bank Indonesia. The foreign currency used in accordance with foreign currency portfolio in Bank Sumsel Babel and VaR calculation method used is by using the model GARCH.