

Analisis perhitungan risiko nilai tukar menggunakan metode stressed value-at-risks dan expected shortfall (studi kasus Bank Mandiri dan Bank BCA) = Foreign exchange risk analysis using stressed value-at-risk and expected shortfall methods case study of Bank Mandiri and Bank BCA

Yokeu Radityatama, author

Deskripsi Lengkap: <https://lib.ui.ac.id/detail?id=20477404&lokasi=lokal>

Abstrak

ABSTRAK

Penelitian ini bertujuan untuk mengukur risiko nilai tukar dengan melakukan perhitungan dengan metode Stressed VaR dan Expected Return serta melakukan analisis strategi dan persiapan implementasi ES dalam mengukur risiko pasar. Data penelitian yang digunakan adalah data kurs nilai tukar harian mata uang Dollar USD , Singapore Dollar SGD , Australian Dollar AUD , Hongkong Dollar HKD , Great Britain Poundsterling GBP , Japanese Yen JPY , EURO dengan periode pengambilan sampel dimulai sejak tanggal 1 Januari 2007 sampai dengan 31 Desember 2017 dan tidak memasukan data pada hari libur. Sampel data portofolio yang digunakan dalam penelitian ini adalah bank Mandiri dan bank BCA. Hasil penelitian ini adalah perhitungan menggunakan metode Expected Shortfall menghasilkan nilai yang lebih besar hampir dua kali lipat bila dibandingkan nilai metode SVaR yang berimplikasi pada beban modal capital charge yang harus disediakan menjadi lebih banyak.

<hr>

ABSTRACT

This study aims to measure exchange rate risk by calculating the Stressed VaR and Expected Return methods and conducting an analysis and preparation of ES implementation in measuring market risk. The research data used are daily average exchange rate data of Dollar USD , Singapore Dollar SGD , Australian Dollar AUD , Hong Kong Dollar HKD , Great Britain Pound Sterling GBP , Japanese Yen JPY , EURO with the sampling period starting from 1 January 2007 to 31 December 2017 excluded holidays date. The sample portfolio data used in this study are Mandiri banks and BCA banks. The results of this study are the calculation using the Expected Shortfall method produces a value that is greater almost double when compared to the value of the SVaR method which has implications for the capital charge must be provided to be more.