



ANALISIS PENGHITUNGAN RISIKO NILAI TUKAR ATAS POSISI DEvisa NETO PT. BANK HAGA DENGAN METODE *VALUE AT RISK* (VaR Method)

Oleh

Giri Prasetyo



© Hak cipta milik IPB, tahun 2010

Hak cipta dilindungi Undang-Undang



Program Pascasarjana Manajemen dan Bisnis
Institut Pertanian Bogor

MB-IPB

**PROGRAM STUDI MAGISTER MANAJEMEN AGRIBISNIS
SEKOLAH PASCASARJANA
INSTITUT PERTANIAN BOGOR
2004**

1. Dilarang mengutip sebagian atau seluruh karya tulis ini tanpa mencantumkan dan menyebutkan sumber :
 - a. Pengutipan hanya untuk kepentingan pendidikan, penelitian, penulisan karya ilmiah, penyusunan laporan, penulisan kritik atau tinjauan suatu masalah.
 - b. Pengutipan tidak merugikan kepentingan yang wajar IPB.
2. Dilarang mengumumkan dan memperbanyak sebagian atau seluruhnya karya tulis ini dalam bentuk apapun tanpa izin IPB.



Hak cipta dilindungi Undang-Undang

© Hak cipta milik IPB, tahun 2010

Prof. Dr. Ir. E. Gumbira Sa'id, MA.Dev



Program Pascasarjana Manajemen dan Bisnis
Institut Pertanian Bogor

MBB-IPB

J u d u l

**: Analisis Penghitungan Risiko Nilai Tukar atas
Posisi Devisa Neto PT. Bank Hoga
dengan Metode *Value At Risk (VaR Method)***

N a m a

: GIRI PRASETYO

N r p

: P065011343.14

Program Studi

: MAGISTER MANAJEMEN AGRIBISNIS

Menyetujui,

1. Komisi Pembimbing

Pembimbing I

Prof. Dr. Ir. Marimin, MSc.

Pembimbing II

Ir. Rita Nurmalina, MS.

2. Ketua Program Studi

3. Dekan Sekolah Pascasarjana

tanggal Lulus :

1. Dilarang mengutip sebagian atau seluruh karya tulis ini tanpa mencantumkan dan menyebutkan sumber :
a. Pengutipan hanya untuk kepentingan pendidikan, penelitian, penulisan karya ilmiah, penyusunan laporan, penulisan kritik atau tinjauan suatu masalah.
b. Pengutipan tidak merugikan kepentingan yang wajar IPB.
2. Dilarang menggunakan dan memperbanyak sebagian atau seluruhnya karya tulis ini dalam bentuk apapun tanpa izin IPB.



Hak cipta dilindungi Undang-Undang

© Hak cipta milik IPB, tahun 2010



Program Pascasarjana Manajemen dan Bisnis
Institut Pertanian Bogor

MB-IPB

PERNYATAAN

Dengan ini saya menyatakan bahwa tesis yang berjudul :

ANALISIS PENGHITUNGAN RISIKO NILAI TUKAR ATAS POSISI DEvisa NETO PT. BANK HAGA DENGAN METODE VALUE AT RISK (VaR Method)

Adalah benar hasil karya saya sendiri yang belum pernah dipublikasikan. Semua sumber data dan informasi yang saya gunakan telah dinyatakan dengan jelas.

Bogor, 19 Juli 2004

Yang Membuat Pernyataan,

Giri Prasetyo

1. Dilarang mengutip sebagian atau seluruh karya tulis ini tanpa mencantumkan dan menyebutkan sumber :
 - a. Pengutipan hanya untuk kepentingan pendidikan, penelitian, penulisan karya ilmiah, penyusunan laporan, penulisan kritik atau tinjauan suatu masalah.
 - b. Pengutipan tidak merugikan kepentingan yang wajar IPB.
2. Dilarang mengumumkan dan memperbanyak sebagian atau seluruhnya karya tulis ini dalam bentuk apapun tanpa izin IPB.

RIWAYAT HIDUP

Penulis dilahirkan di Purbalingga, Jawa Tengah pada tanggal 3 September 1969 sebagai anak ke-4 dari pasangan Soeparlan Wirjoatmodjo dan Moeldijati. Pendidikan sarjana ditempuh di Program Studi Teknologi Industri Pertanian, Fakultas Teknologi Pertanian, Institut Pertanian Bogor. Pada tahun 2001, penulis diterima di Program Studi Magister Manajemen, Sekolah Pascasarjana, Institut Pertanian Bogor. Saat ini penulis bekerja sebagai staf di Divisi Risk Management and Compliance, PT. Bank Haga, Jakarta.

© Hak cipta milik IPB, tahun 2010



Hak cipta dilindungi Undang-Undang



MB-IPB
Program Pascasarjana Manajemen dan Bisnis
Institut Pertanian Bogor

1. Dilarang mengutip sebagian atau seluruh karya tulis ini tanpa mencantumkan dan menyebutkan sumber :
 - a. Pengutipan hanya untuk kepentingan pendidikan, penelitian, penulisan karya ilmiah, penyusunan laporan, penulisan kritik atau tinjauan suatu masalah.
 - b. Pengutipan tidak merugikan kepentingan yang wajar IPB.
2. Dilarang mengumumkan dan memperbanyak sebagian atau seluruhnya karya tulis ini dalam bentuk apapun tanpa izin IPB.



KATA PENGANTAR

Puji syukur ke hadirat Illahi Rabbi yang Maha Pengasih dan Penyayang, atas rahmat dan karunia-Nya, penulis dapat menyelesaikan penyusunan tesis yang berjudul : “ Analisis Penghitungan Risiko Nilai Tukar atas Posisi Devisa Neto PT. Bank Hoga “.

Tesis ini disusun dalam rangka memenuhi salah satu syarat untuk memperoleh gelar Magister Manajemen pada Program Studi Magister Manajemen Agribisnis, Sekolah Pascasarjana, Institut Pertanian Bogor.

Selama masa penelitian hingga selesainya penulisan tesis ini, penulis banyak sekali mendapat dorongan, bantuan, bimbingan, saran serta masukan dari berbagai pihak. Untuk itu penulis mengucapkan terimakasih dan penghargaan yang setinggi-tingginya kepada yang terhormat :

1. Prof. Dr. Ir. Marimin, MSc, dosen pembimbing pertama pada penelitian ini.
2. Ir. Rita Nurmalina, MS, dosen pembimbing kedua.
3. Bapak Wimboh, Peneliti Senior DPNP , Bank Indonesia.
4. Ayahandayani Kussetyowati, SE.Akt,MBA, Ka-Sie DPBPR, Bank Indonesia.
5. Bapak Soeparlan, Ibu Moeldijati, Kakak dan Adik atas dukungan dan doa yang diberikan.
6. Yang tercinta Ani dan Hanif terimakasih atas pengertian dan pengorbanan yang telah diberikan.
7. Bapak Budiarto Santoso, Kadiv. Risk Manajemen and Compliance, PT. Bank Hoga.
8. Seluruh Dosen dan Staff Program Studi Magister Manajemen Agribisnis, Institut Pertanian Bogor.
9. Rekan-rekan Mahasiswa MMA –IPB angkatan 14.
10. Rekan-rekan di Divisi Risk Manajemen and Compliance, Bank Hoga
11. Rekan-rekan di Financial Control and Accounting, Bank Hoga.
12. Rekan-rekan di Treasury and Settlement, Bank Hoga.
13. Rekan-rekan di Indonesian Risk Professional Association (IRPA).

Semoga amal baik yang telah diberikan mendapat limpahan rahmat dari Alloh yang Maha Pemurah.

Penulis menyadari sepenuhnya, bahwa tesis ini masih jauh dari kesempurnaan. Saran dan kritik yang bersifat membangun sangat penulis harapkan. Semoga tesis dapat memberikan manfaat.

Bogor, 17 Juli 2004

Penulis

Hak cipta dilindungi Undang-Undang



Program Pascasarjana Manajemen dan Bisnis
Institut Pertanian Bogor
MB-IPB

1. Dilarang mengutip sebagian atau seluruh karya tulis ini tanpa mencantumkan dan menyebutkan sumber :
a. Pengutipan hanya untuk kepentingan pendidikan, penelitian, penulisan karya ilmiah, penyusunan laporan, penulisan kritik atau tinjauan suatu masalah.
b. Pengutipan tidak merugikan kepentingan yang wajar IPB.
2. Dilarang mengumumkan dan memperbanyak sebagian atau seluruhnya karya tulis ini dalam bentuk apapun tanpa izin IPB.