

Evaluasi perhitungan Value at Risk dengan simulasi Monte Carlo dan simulasi historis pada tiga bank Badan Usaha Milik Negara (BUMN) =
Evaluation of value at risk calculations with simulation Monte Carlo and historical simulation on three banks State-Owned Banks (BUMN)

Suhadi, examiner

Deskripsi Lengkap: <https://lib.ui.ac.id/detail?id=20316113&lokasi=lokal>

Abstrak

Eksposur resiko menjadi perhatian penting pada sebuah investasi. Khususnya pada bankbank milik Negara, karena banyak pelaku terlibat.bermain disana. PT Bank Mandiri, PT Bank Negara Indonesia dan PT Bank Rakyat Indonesia perlu mengetahui seberapa besar risiko kerugian yang dapat dialami karena memiliki portfolio investasi 3 saham tersebut. Dalam karya akhir ini akan dihitung besarnya nilai VaR dengan metode monte carlo dan simulasi historis selama 2 tahun lalu dites aktualnya pada tahun ketiga dengan hasil perhitungan 2 tahun sebelumnya. Didapati bahwa pada tinglat Alpha Historis smulasi 5% terdapat 10 kali penyimpangan sedangkan monte carlo ada 11 kali penyimpangan. Hal ini dapat menjadi dasar penggunaan metode apa yang tepat untuk mengukur sebuah resiko.

.....Exposure to risk is important concern at an investment. Especially at the state-owned banks, because there are many actors involved.. PT Bank Mandiri, PT Bank Negara Indonesia and PT Bank Rakyat Indonesia needs to know how much the risk of loss can be experienced as it has an investment portfolio of three stocks. In this final paper will count the value of VaR to the monte carlo method and historical simulation over 2 years ago actually tested in the third year with the calculated two years earlier. Found that the Historical Simulation at Alpha 5% deviation whereas there were 10 times 11 times monte carlo any irregularities. This can be the basis of what is appropriate use of methods to measure a risk.