

Analisis cadangan risiko operasional unit Bisnis EPC dengan metode Loss Distribution Approach = Analysis of operational risk in EPC Business unit using Loss Distribution Approach

Lydia Tiara, author

Deskripsi Lengkap: <https://lib.ui.ac.id/detail?id=9999920540194&lokasi=lokal>

Abstrak

Abstrak ini menggambarkan analisis komprehensif mengenai risiko operasional yang terkait dengan pelaksanaan proyek Engineering, Procurement, dan Construction (EPC) dengan menggunakan metode Loss Distribution Approach (LDA). Penelitian ini menggunakan data historikal kerugian operasional pelaksanaan proyek EPC sejak Januari 2019 hingga Desember 2022. Penelitian ini menunjukkan nilai Operational Value At Risk sebesar Rp17,68 miliar dengan percentile 95% dan Rp41,44 miliar dengan percentile 99% yang telah dinyatakan valid setelah dilakukan Back Testing. Dengan dilakukannya analisis kerugian berbasis data historikal, diharapkan perusahaan EPC yang mengalami kerugian dapat memahami dan menjadikan penelitian ini sebagai lesson learned dan memitigasi risiko operasional yang mungkin terjadi pada proyek yang sedang berjalan sehingga potensi kerugian dapat diminimalisir.

.....This abstract describes a comprehensive analysis of operational risks in engineering, procurement, and construction (EPC) business by using calculation of loss distribution approach methods. This research uses the historical of operational losses from January 2019 to December 2022. This research shows the Operational Value At Risk is Rp17,68 billion with percentile 95% and Rp41,44 billion with a percentile of 99% and declared valid after Back Testing. By carrying out analysis losses based on historical data, the EPC companies are expected to be able to understand and make this research a lesson learned and mitigate operational risks that may occur in ongoing projects in order to minimize the potential loss.