Universitas Indonesia Library >> UI - Skripsi Membership

Analisis penerapan metode loss distribution approach dalam perhitungan risiko operasional Bank : studi pada bank XYZ

Hendra Priatna, author

Deskripsi Lengkap: https://lib.ui.ac.id/detail?id=125917&lokasi=lokal

---

Abstrak

Bank XYZ menghadapi potensi kerugian risiko operasional namun belum memiliki metode pengukuran risiko yang akurat. Penelitian ini mencoba menerapkan Metode Loss Distributiopn Approach sebagai salah satu alternatif model perhitungan risiko operasional. Data yang digunakan adalah data internal Bank XYZ kurun waktu periode Januari 2002 hingga Desember 2005. Hasil uji backtesting dengan membandingkan hasil perhitungan lewat model pendekatan yang digunakan dengan data kerugian operasional aktual menunjukkan metode tersebut dapat digunakan sebagai alternatif pengukuran risiko operasional bagi Bank XYZ.