Perhitungan taksiran Value at Risk dengan metode simulasi historis

Deskripsi Lengkap: <https://lib.ui.ac.id/detail?id=20180933&lokasi=lokal>

Abstrak

Beberapa tahun belakangan ini, value at risk (VaR) semakin sering digunakan dalam mengukur risiko finansial. Cara yang populer digunakan adalah metode Delta Normal dan metode simulasi Monte-Carlo. Pada tugas akhir ini akan dibahas metode simulasi historis. Metode ini menggunakan data-data terdahulu untuk memperoleh nilai VaR. Terkadang sulit mendapatkan data dalam jumlah yang besar, keadaan ini menimbulkan keraguan mengenai ketepatan hasil taksiran yang diperoleh. Cara yang banyak digunakan dalam mengolah data berukuran kecil agar menjadi lebih layak adalah dengan bootstrap. Sehingga di beberapa literatur, metode simulasi historis disebut juga dengan metode bootstrap. Metode bootstrap ini akan diterapkan pada suatu data penghasilan, sehingga diperoleh taksiran VaR dari data tersebut. Bootstrap layak digunakan karena memberikan suatu nilai taksiran tak bias, dengan variansi yang mengecil.