

Pengukuran operational value at risk atas pemberhentian pegawai pada instansi xyz dengan loss distribution approach - actuarial model = Operational value at risk measurement on dismissal of employment in xyz institution by loss distribution approach - actuarial model

Among Wiwoho, author

Deskripsi Lengkap: <https://lib.ui.ac.id/detail?id=20281478&lokasi=lokal>

Abstrak

Komposisi pegawai Instansi XYZ yang sebagian besar berasal dari mahasiswa ikatan dinas, memunculkan potensi risiko berupa kerugian Instansi jika pegawai tersebut berhenti sebelum masa ikatan dinas berakhir. Dengan demikian, Instansi XYZ perlu memberikan perhatian yang khusus atas risiko yang berkaitan dengan sumberdaya manusia. Berhentinya pegawai merupakan salah satu risiko operasional yang berkaitan dengan sumberdaya manusia. Pengukuran risiko yang merupakan salah satu tahapan dalam manajemen risiko dan akan digunakan sebagai salah satu langkah bagi Instansi XYZ dalam menerapkan manajemen risiko.

Penelitian yang dilakukan menyimpulkan bahwa (1) dengan Chi-Square goodness of fit test, frequency of loss distribution pemberhentian pegawai sebelum masa ikatan dinas berakhir pada Instansi XYZ mengikuti distribusi Poisson karena hasilnya signifikan pada tingkat keyakinan 95% maupun 99%; (2) dengan Chi-Square goodness of fit test, distribusi severitas kerugian pemberhentian pegawai mengikuti distribusi Lognormal pada confidence level 95% maupun 99%; (3) Pengukuran OpVaR dengan menggunakan Loss Distribution Approach - Actuarial Model memperoleh nilai Operational Value at Risk (OpVaR) pada tingkat keyakinan 95 % sebesar Rp 220.683.463,00 dan untuk tingkat keyakinan 99% sebesar Rp 348.157.546,00; (4) pengujian validitas model dengan Kupiec Test untuk confidence level 95% dan 99% menunjukkan Loss Distribution Approach - Actuarial Model valid untuk digunakan dalam pengukuran Operational Value at Risk (OpVaR) atas pemberhentian pegawai sebelum masa ikatan dinas berakhir pada Instansi XYZ.

.....The composition of XYZ Institution's employees who mostly come from the students bond department, raises the potential risk of loss when the employee quit before the end of his official bond. Thus, XYZ Institution should give particular attention on the risks associated with human resources. Dismissal of employees is one of the operational risk associated with human resources. Risk measurement is one of the stages in risk management and to be used as one step for the XYZ Institution in applying risk management. Research carried out the conclusion that (1) by Chi-Square goodness of fit test, the frequency of loss distribution on dismissal of employees before the period ends on his official bond in XYZ Institution follows a Poisson distribution because the results are significant at a confidence level of 95% or 99%, (2) with Chi-Square goodness of fit test, the distribution of loss severity on dismissal of employees follows the lognormal distribution at the confidence level of 95% or 99%, (3) Measuring OpVar using the Loss Distribution Approach - Actuarial Models obtained value of Operational Value at Risk (OpVar) at the confidence level of 95% amounting IDR 220,683,463.00 and for the confidence level of 99% amounting IDR 348,157,546.00, (4) test on validity of the model with the Kupiec test for the confidence level of 95% and 99% indicated that Loss Distribution Approach - Actuarial Models is valid for the usage in measuring Operational Value at Risk (OpVar) over the dismissal of employees before the period ends on his official

bond in XYZ Institution.