

Analisa Dampak Risiko Kekonomian Dalam Pengembangan Proyek Biodiesel Dengan Pendekatan Value-at-Risk = Financial Risk Impact Analysis in Biodiesel Project Development Using the Value at Risk Approach

Furqon Ahda, author

Deskripsi Lengkap: <https://lib.ui.ac.id/detail?id=9999920543717&lokasi=lokal>

Abstrak

Penelitian ini mengkaji potensi risiko finansial yang terkait dengan pengembangan proyek biodiesel, fokus pada studi kasus PT DYZ di Tarjun (Kalimantan) dan Marunda (Jawa). Dalam penelitian ini, diterapkan pendekatan komprehensif dengan memanfaatkan teknik Value at Risk (VaR) dan simulasi Monte Carlo untuk mengevaluasi serta menganalisis ketidakpastian finansial yang mungkin timbul dalam proyek tersebut. Tujuan penelitian ini adalah untuk meningkatkan pemahaman mengenai dinamika keuangan proyek biodiesel dan memberikan wawasan untuk merancang strategi mitigasi risiko yang lebih baik. Melalui penerapan VaR, tesis ini mengukur potensi kerugian yang mungkin dihadapi PT DYZ dalam berbagai skenario. Selain itu, simulasi Monte Carlo digunakan untuk memodelkan performa keuangan proyek di bawah kondisi pasar yang beragam, memberikan sudut pandang dinamis terhadap eksposur risiko. Hasil penelitian ini memberikan informasi berharga bagi para pemangku kepentingan yang terlibat dalam pengembangan proyek biodiesel, memungkinkan pengambilan keputusan yang informasional dan perbaikan strategi manajemen risiko.

.....This study examines the potential financial risks associated with the development of a biodiesel project, focusing on a case study of PT DYZ in Tarjun (Kalimantan) and Marunda (Jawa). In this research, a comprehensive approach is employed, utilizing the Value at Risk (VaR) technique and Monte Carlo simulations to evaluate and analyze the financial uncertainties that may arise in the project. The objective of this study is to enhance the understanding of the financial dynamics of the biodiesel project and to provide insights for designing better risk mitigation strategies. Through the application of VaR, this thesis measures the potential losses that PT DYZ might face under various scenarios. Furthermore, Monte Carlo simulation is used to model the financial performance of the project under diverse market conditions, offering a dynamic perspective on risk exposure. The findings of this study provide valuable information for stakeholders involved in the development of biodiesel projects, enabling informed decision-making and improvements in risk management strategies.