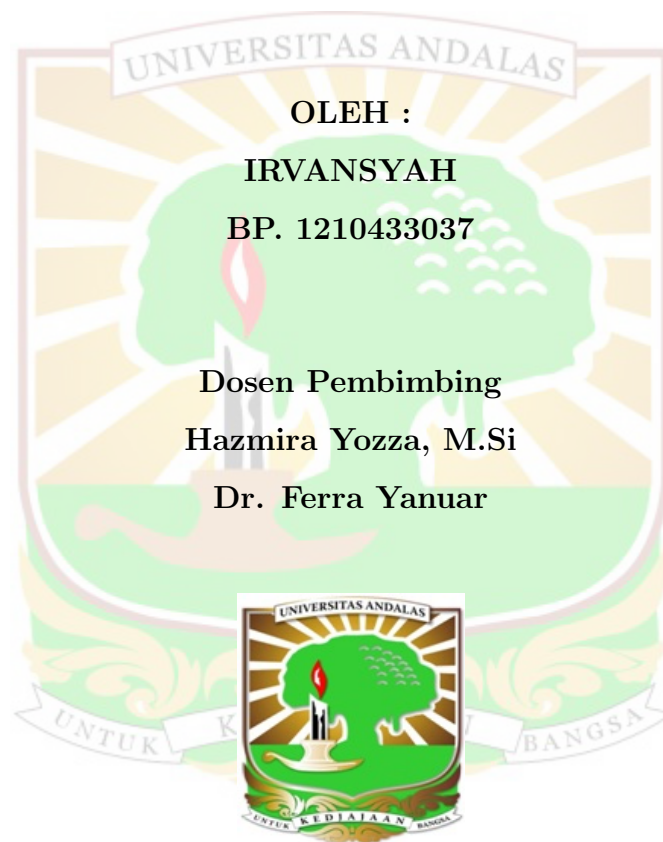


**PERHITUNGAN *VALUE AT RISK* (*VaR*) PORTOFOLIO
OPTIMAL DENGAN METODE SIMULASI MONTE CARLO**

SKRIPSI SARJANA MATEMATIKA



OLEH :

IRVANSYAH

BP. 1210433037

Dosen Pembimbing

Hazmira Yozza, M.Si

Dr. Ferra Yanuar

JURUSAN MATEMATIKA

FAKULTAS MATEMATIKA DAN ILMU PENGETAHUAN ALAM

UNIVERSITAS ANDALAS

PADANG

2017

ABSTRAK

Value at Risk (VaR) adalah estimasi kerugian maksimum yang akan didapat selama periode waktu tertentu dalam kondisi pasar normal pada tingkat kepercayaan tertentu. Dalam Penelitian ini, *VaR* portofolio dihitung dengan metode simulasi Monte Carlo. *VaR* portofolio dengan metode simulasi Monte Carlo mengasumsikan bahwa *return - return* saham pembentuk portofolio berdistribusi normal, sehingga *return* portofolio berdistribusi normal multivariat yang kemudian disimulasikan dengan menggunakan parameter yang sesuai. Pada intinya *VaR* dengan metode simulasi Monte Carlo adalah dengan melakukan simulasi dengan membangkitkan bilangan random dengan membangkitkan bilangan acak untuk mengestimasi nilai *VaR*-nya. Perhitungan *Value at Risk (VaR)* dengan simulasi Monte Carlo pada tingkat kepercayaan 95% dan periode waktu 1 hari.

Kata kunci : *Value at Risk, Simulasi Monte Carlo, Portofolio .*

