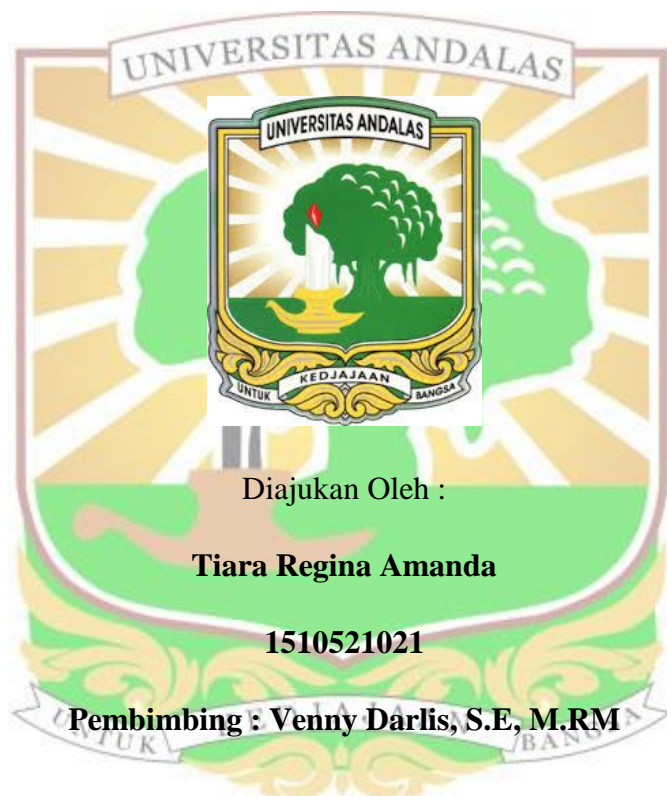


**PERHITUNGAN *VALUE AT RISK* DENGAN METODE *HISTORICAL SIMULATION*, *VARIANCE COVARIANCE* DAN *MONTE CARLO SIMULATION* (*COMPARATIVE STUDY: PERUSAHAAN - PERUSAHAAN YANG TERDAFTAR DI JAKARTA ISLAMIC INDEX*)**

**SKRIPSI**

Diajukan sebagai Salah Satu Syarat untuk Mencapai Gelar Sarjana pada Program Studi S1 Jurusan Manajemen Fakultas Ekonomi Universitas Andalas




**PROGRAM STUDI S1 JURUSAN MANAJEMEN**

**FAKULTAS EKONOMI**

**UNIVERSITAS ANDALAS**

**PADANG**

**APRIL 2019**

	No. Alumni Universitas	<b>Tiara Regina Amanda</b>	No. Alumni Fakultas
	a) Tempat / Tgl Lahir: Bukittinggi / 06 Januari 1997, b) Nama Orang Tua: Darman dan Zulwita, c) Fakultas: Ekonomi, d) Jurusan: Manajemen, e) No Bp: 1510521021, f) Tanggal Lulus: 11 April 2019, g) Predikat Lulus: Sangat Memuaskan, h) IPK: 3,31 i) Lama Studi: 3 Tahun 8 Bulan, j) Alamat Orang Tua: Jl. Mr. Asaat, No 31, Sanjai, Kel. Manggis Ganting, Kec. Mandiangin Koto Selayan, Bukittinggi		

**PERHITUNGAN VALUE AT RISK DENGAN METODE HISTORICAL SIMULATION, VARIANCE COVARIANCE, DAN MONTE CARLO SIMULATION (COMPARATIVE STUDY: PERUSAHAAN – PERUSAHAAN YANG TERDAFTAR DI JAKARTA ISLAMIC INDEX)**

Skripsi Oleh : *Tiara Regina Amanda*  
Pembimbing : *Venny Darlis, S.E, M.RM*


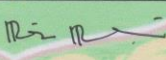
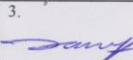
**ABSTRAK**

Penelitian ini bertujuan untuk menghitung dan memvalidasi serta membandingkan nilai *Value At Risk* dengan metode *Historical Simulation*, *Variance Covariance* dan *Monte Carlo Simulation*. Populasi pada penelitian ini adalah perusahaan - perusahaan yang terdaftar di Jakarta Islamic index. Teknik pengambilan sampel yang digunakan adalah *purposive sampling* yaitu dengan kriteria yang harus dipenuhi oleh sampel. Sampel penelitian ini yaitu sebanyak 15 perusahaan dengan menghitung nilai VaR periode Juni 2017 – Mei 2018. Pengolahan data pada penelitian ini dilakukan dengan menggunakan STATA versi 14. Pegujian validitas menggunakan metode *Backtesting Kupiec* dan *Basel Traffic Light*. Hasil penelitian menunjukkan bahwa *Monte Carlo Simulation* merupakan metode terbaik dan paling valid dibandingkan dua metode lainnya. Perhitungan *Value at risk* menggunakan metode *Historical Simulation*, *Variance Covariance* dan *Monte Carlo Simulation*.

Kata Kunci : *Value At Risk (VaR)*, *Historical Simulation*, *Variance Covariance*, *Monte Carlo Simulation*, *Backtesting Kupiec*, *Backtesting Basel Traffic Light*

Skripsi telah dipertahankan di depan seminar hasil dan dinyatakan lulus pada tanggal **11 April 2019**

Abstrak telah disetujui oleh:

Tanda Tangan	1. 	2. 	3. 
Nama Terang	Venny Darlis, S.E, M.RM	Dr. Rida Rahim, S.E, M.E	M. Fanny Alfarisi, SE, MsFin, Ph.D

Mengetahui,  
Ketua Jurusan Manajemen

Dr. Verinita, S.E., M.Si  
NIP. 197208262003122004



Alumni telah mendaftar ke Fakultas/Universitas dan mendapat nomor alumnus :

		Petugas Fakultas/Universitas	
No. Alumni Fakultas	Nama	TandaTangan	
No. Alumni Universitas	Nama	TandaTangan	