

## HKI PROGRAM KOMPUTER

### GUI Value at Risk (VaR) Metode Historical Simulation (HS) dan Uji Akurasinya Menggunakan Backtesting

#### Deskripsi Aplikasi

Aplikasi GUI Value at Risk (VaR) Metode Historical Simulation (HS) dan Uji Akurasinya Menggunakan Backtesting adalah aplikasi yang disusun untuk membantu praktisi dan investor dalam memperkirakan besarnya nilai risiko kerugian investasi aset tunggal pada masa yang akan datang. Prediksi risiko kerugian diukur dengan nilai Value at Risk (VaR) berdasarkan pada imbal hasil (return) historis dengan memperhatikan besarnya nilai investasi, tingkat kepercayaan, dan periode kepemilikan investasi. Metode Historical Simulation (HS) merupakan metode non parametrik yang free of assumptions sehingga model ini dapat digunakan pada setiap data aset. Uji akurasi prediksi risiko menggunakan metode Backtesting dengan didasarkan pada nilai rasio pelanggaran atau violation ratio.

