

HKI PROGRAM KOMPUTER

R-Graphical User Interface (R-GUI) Pengukuran Risiko Glue-Value-at-Risk pada Data Distribusi Normal

Deskripsi Aplikasi

Aplikasi GUI Glue Value at Risk (Glue-VaR) adalah aplikasi yang disusun untuk membantu praktisi dan investor dalam memperkirakan besarnya nilai risiko kerugian investasi aset tunggal pada masa yang akan datang. Meskipun dikenakan pada aset tunggal, pada aplikasi ini pengguna dapat mengukur risiko investasi pada 3 aset secara bersamaan. Pada aplikasi ini, prediksi risiko kerugian diukur berdasarkan nilai imbal hasil (return) historis. Untuk menggunakan model Glue Value at Risk (Glue-VaR), terdapat satu asumsi yang harus terpenuhi, yaitu nilai return harus berdistribusi Normal. Jika asumsi Normalitas tidak terpenuhi, maka analisis tidak dapat dilakukan karena akan memberikan hasil yang bias (tidak akurat).

