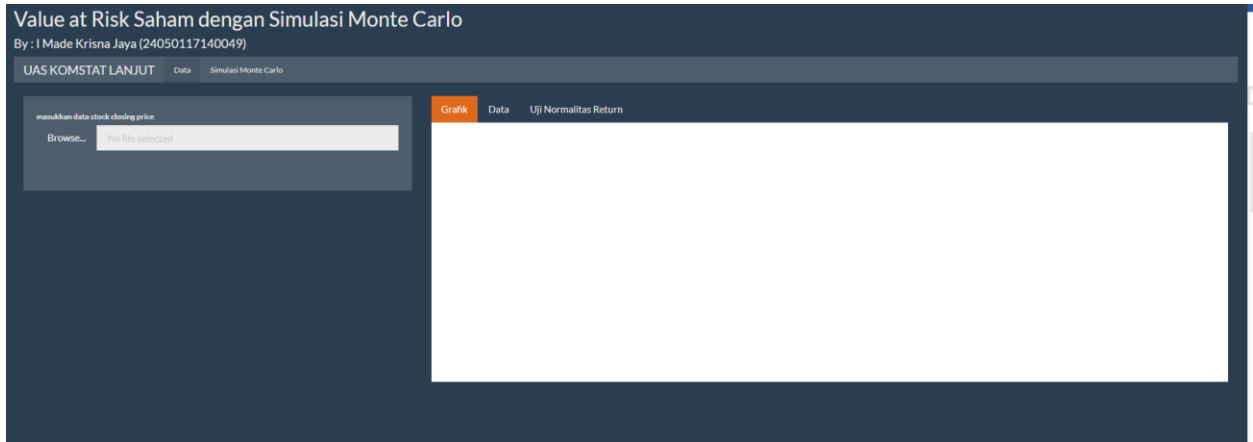
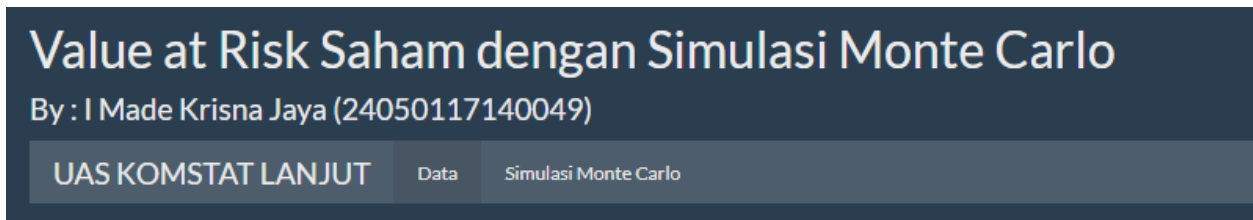


PENGENALAN USER INTERFACE

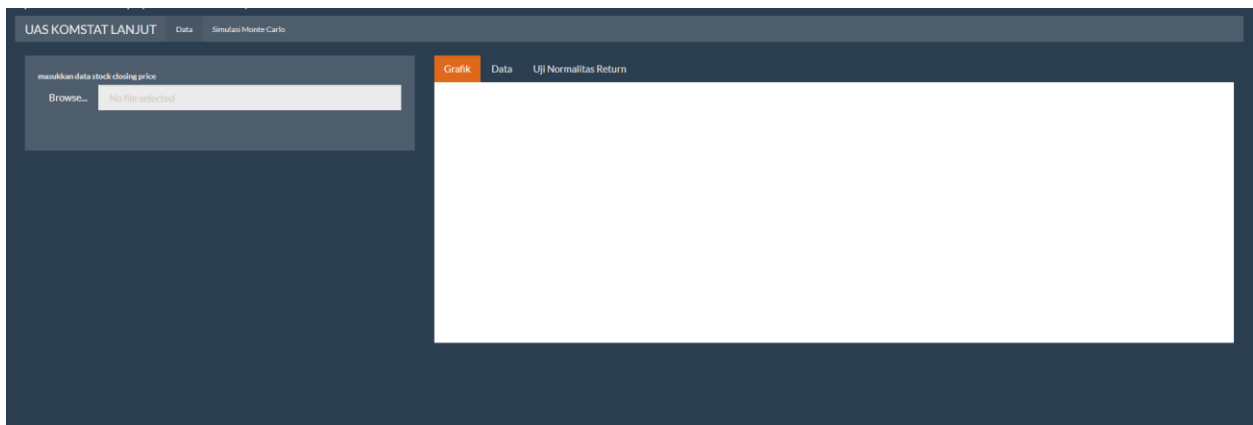
- Tampilan awal ketika GUI dijalankan



- Terdapat dua menu panel, yaitu menu panel data dan menu panel Simulasi Monte Carlo. Menu panel simulasi monte carlo berfungsi untuk menentukan nilai investasi awal, banyaknya ulangan simulasi yang dilakukan serta menampilkan iterasi dan nilai VaR dari data yang digunakan.



- Menu panel data berfungsi untuk input data yang digunakan, menampilkan grafik time series data,



menampilkan statistik deksriptif data

UAS KOMSTAT LANJUT Data Simulasi Monte Carlo

masukkan data stock closing price

Browse... No file selected

Grafik Data Uji Normalitas Return

NULL

NULL

NULL

serta uji normalitas dari return data saham.

Value at Risk Saham dengan Simulasi Monte Carlo

By : I Made Krisna Jaya (24050117140049)

UAS KOMSTAT LANJUT Data Simulasi Monte Carlo

masukkan data stock closing price

Browse... No file selected

Grafik Data Uji Normalitas Return

NULL

- Menu panel simulasi monte carlo berfungsi untuk menentukan nilai investasi awal, banyaknya ulangan simulasi yang dilakukan serta menampilkan iterasi dan nilai VaR dari data yang digunakan.

Value at Risk Saham dengan Simulasi Monte Carlo

By : I Made Krisna Jaya (24050117140049)

UAS KOMSTAT LANJUT Data Simulasi Monte Carlo

Investasi Awal

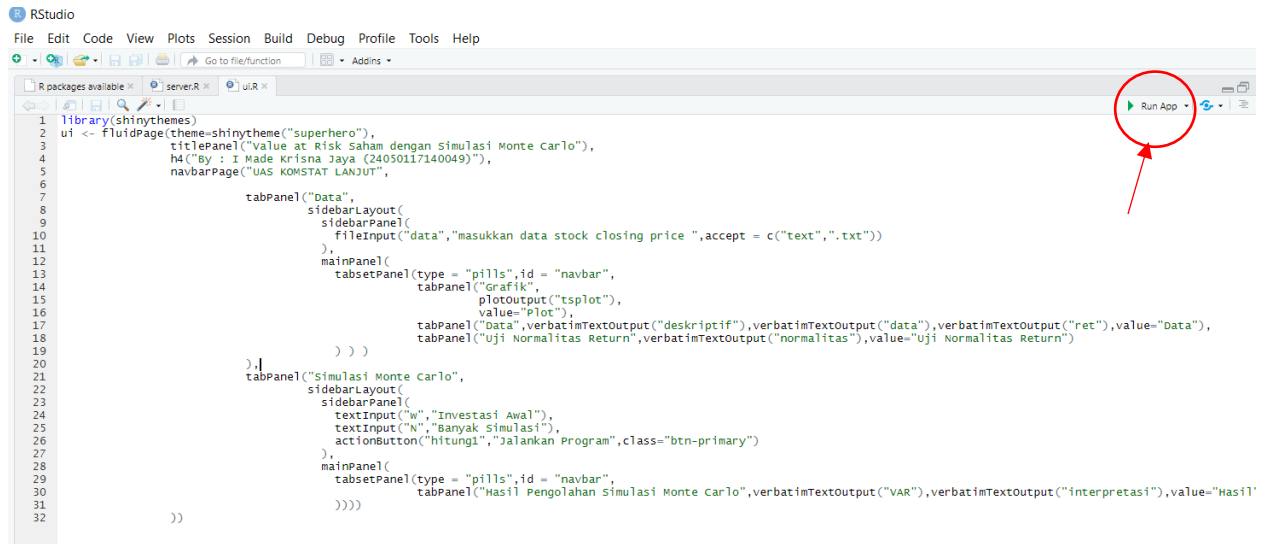
Banyak Simulasi

Jalankan Program

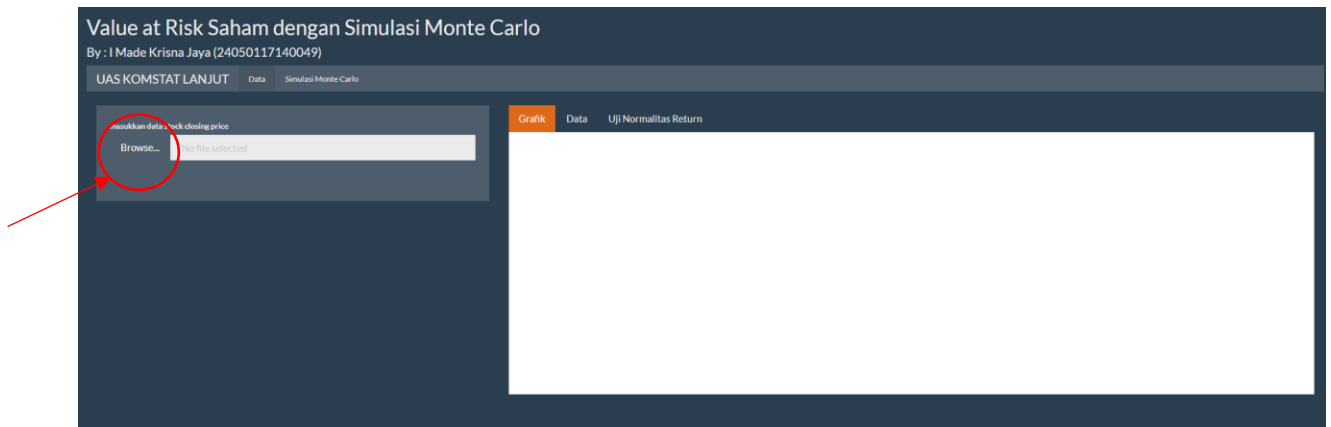
Hasil Pengolahan Simulasi Monte Carlo

LANGKAH-LANGKAH PENGOPERASIAN

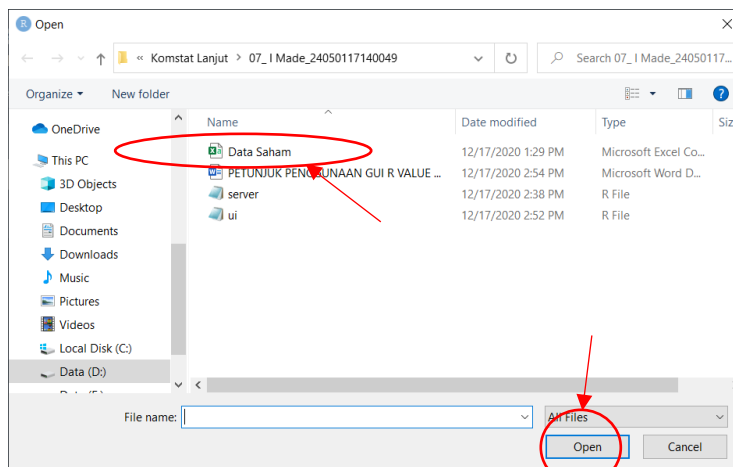
1. Buka GUI R dengan menjalankan ui.R dan server.R



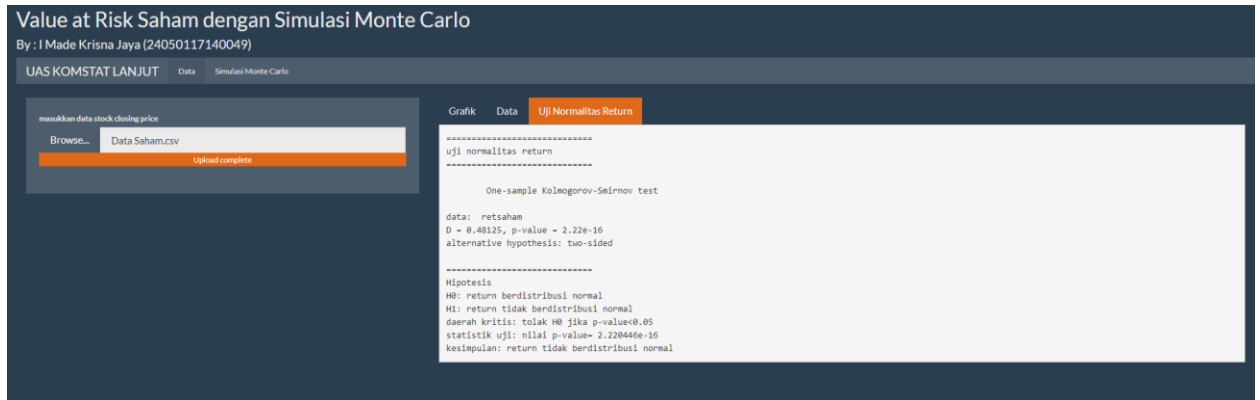
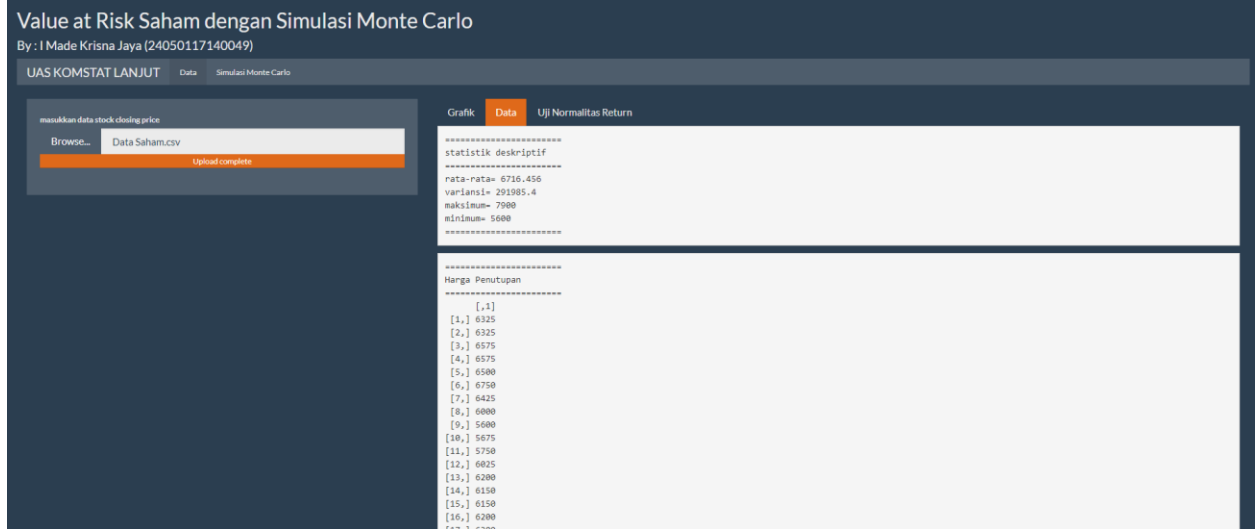
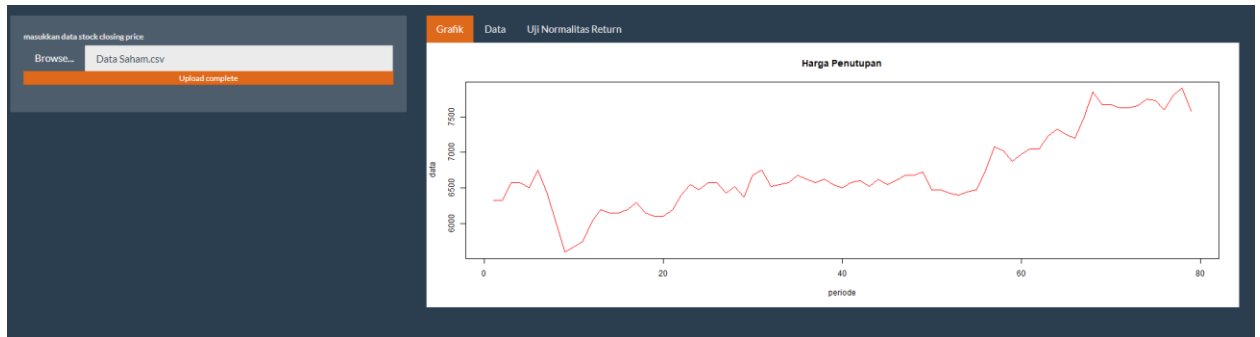
2. Pada panel data, input data yang akan digunakan menggunakan button browse



3. pilih file yang akan digunakan kemudian tekan open



4. terlihat tampilan hasil grafik, data, serta hasil uji normalitas pada return data saham



5. Beralih pada panel simulasi monte carlo, kemudian masukkan nilai investasi dan jumlah iterasi monte carlo yang akan dilakukan.

Value at Risk Saham dengan Simulasi Monte Carlo

By : I Made Krisna Jaya (24050117140049)

UAS KOMSTAT LANJUT Data Simulasi Monte Carlo

Investasi Awal

Banyak Simulasi

Jalankan Program

Hasil Pengolahan Simulasi Monte Carlo

6. Terlihat hasil iterasi serta nilai VaR dari data saham yang digunakan

Hasil Pengolahan Simulasi Monte Carlo				
Nilai VaR dengan Simulasi Monte Carlo untuk tingkat kepercayaan :				
99%	97.5%	95%	90%	
[1,] -50390557243 -43461376379 -37800824397 -27378806631				
[2,] -55792967164 -44704477376 -34870519272 -29299784636				
[3,] -54594556467 -44884336036 -34483141975 -29365560167				
[4,] -52402492382 -40980639101 -34490276466 -28928671944				
[5,] -50590833005 -40664274785 -36732957396 -28142998971				
[6,] -51213183667 -41725812567 -35959346952 -26283019367				
[7,] -52686063823 -43019061696 -35548362134 -26720450484				
[8,] -49956344630 -41424200618 -36655522083 -26279452533				
[9,] -50316687166 -44302418822 -34343630335 -28249818319				
[10,] -48699887405 -45020456913 -37417612301 -27122828851				
[11,] -51945892753 -41042084954 -38940179554 -27103203394				
[12,] -50462861219 -40337589986 -3490224379 -26937962520				
[13,] -50350071583 -43239814931 -38287165252 -27307046106				
[14,] -53344473023 -45347831663 -33292093224 -28873408319				
[15,] -52963633993 -43469068856 -35604364909 -27353140793				
[16,] -55843425068 -41494843518 -34804215668 -25297376761				
[17,] -52644566976 -38026586747 -37103290272 -26050841213				
[18,] -50495731303 -43948132541 -35965800714 -26587766197				
[19,] -54244408509 -47782664200 -34720596994 -25723979116				
[100,] -47591541516 -47832347969 -35196551930 -28017908402				
Rata-rata nilai VaR dengan 100 kali ulangan untuk tingkat kepercayaan :				
99%	97.5%	95%	90%	
-51600414760	-43169872645	-35799827365	-27386006212	
nilai rata-rata VaR diatas sesuai dengan tingkat kepercayaan dan pengulangan yang anda input menunjukan kerugian maksimal dalam satu periode kedepan				