

SKRIPSI

**PENENTUAN RETENSI OPTIMAL UNTUK REASURANSI *STOP LOSS*
DENGAN METODE *VALUE AT RISK* DAN *CONDITIONAL TAIL*
*EXPECTATION***

**(*DETERMINATION THE OPTIMAL RETENTION FOR STOP LOSS
REINSURANCE USING THE VALUE AT RISK AND CONDITIONAL TAIL
EXPECTATION METHODS*)**



Editha Anggrieniputri Kinbenu

19/445626/PA/19450

**PROGRAM SARJANA PROGRAM STUDI ILMU AKTUARIA
DEPARTEMEN MATEMATIKA
FAKULTAS MATEMATIKA DAN ILMU PENGETAHUAN ALAM
UNIVERSITAS GADJAH MADA
YOGYAKARTA**

2022

SKRIPSI

**PENENTUAN RETENSI OPTIMAL UNTUK REASURANSI *STOP LOSS*
DENGAN METODE *VALUE AT RISK* DAN *CONDITIONAL TAIL*
*EXPECTATION***

**(*DETERMINATION THE OPTIMAL RETENTION FOR STOP LOSS*
REINSURANCE USING THE VALUE AT RISK AND CONDITIONAL TAIL
EXPECTATION METHODS)**

Diajukan untuk memenuhi salah satu syarat memperoleh derajat
Sarjana Program Sarjana Program Studi Ilmu Aktuaria



Editha Anggrieniputri Kinbenu

19/445626/PA/19450

**PROGRAM SARJANA PROGRAM STUDI ILMU AKTUARIA
DEPARTEMEN MATEMATIKA
FAKULTAS MATEMATIKA DAN ILMU PENGETAHUAN ALAM
UNIVERSITAS GADJAH MADA
YOGYAKARTA**

2022

HALAMAN PENGESAHAN

SKRIPSI


**PENENTUAN RETENSI OPTIMAL UNTUK REASURANSI
STOP LOSS DENGAN METODE VALUE AT RISK DAN
CONDITIONAL TAIL EXPECTATION**

Telah dipersiapkan dan disusun oleh


Editha Anggrieniputri Kinbenu
19/445626/PA/19450

Telah dipertahankan di depan Tim Penguji
pada tanggal 18 April 2023

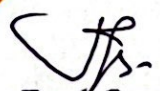
Susunan Tim Penguji



Prof. Dr. rer.nat. Dedi Rosadi, S.Si., M.Sc.
Pembimbing Utama



Dr. Nanang Susyanto, S.Si., M.Sc., M.Act.Sc.
Ketua Tim Penguji



Danang Teguh Ooyyimi, S.Si. M.Sc., Ph.D.
Penguji

Mengetahui,
a.n. Dekan FMIPA UGM
Wakil Dekan Bidang Pendidikan, Pengajaran
dan Kemahasiswaan



Prof. Drs. Roto, M.Eng., Ph.D.
NIP. 196711171993031020