

DAFTAR ISI

HALAMAN PENGESAHAN.....	ii
PERNYATAAN BEBAS PLAGIASI.....	iii
HALAMAN PERSEMBAHAN.....	iv
HALAMAN MOTTO	v
PRAKATA	vi
DAFTAR ISI.....	viii
DAFTAR TABEL	x
DAFTAR GAMBAR	xi
DAFTAR LAMBANG.....	xii
DAFTAR LAMPIRAN	xiii
INTISARI.....	xiv
ABSTRACT	xv
BAB I PENDAHULUAN	1
1.1 Latar Belakang Masalah.....	1
1.2 Tujuan dan Manfaat Penelitian	4
1.3 Tinjauan Pustaka	4
1.4 Metodologi Penelitian	5
1.5 Sistematika Penulisan	6
BAB II LANDASAN TEORI	7
2.1 Variabel Random	7
2.2 Fungsi Kepadatan Probabilitas (PDF).....	7
2.3 Fungsi Distribusi Kumulatif (CDF)	8
2.4 Fungsi Survival	9

2.5 Distribusi Lognormal	9
2.6 Tingkat Signifikansi (Alpha).....	12
2.7 Sistem Asuransi dan Reasuransi	13
2.8 Reasuransi <i>Stop-loss</i> dan Retensi Optimalnya.....	14
2.9 Prinsip Perhitungan Premi.....	17
2.10 Prinsip Nilai Ekspektasi	18
2.11 <i>Value at Risk</i>	20
2.12 <i>Conditional Tail Expectation</i>	23
BAB III METODE PENELITIAN.....	28
3.1 Kriteria Optimisasi Berdasarkan <i>Value at Risk</i>	28
3.2 Retensi Optimal Pada Optimisasi <i>Value at Risk</i>	29
3.3 Kriteria Optimisasi Berdasarkan <i>Conditional Tail Expectation</i>	42
3.4 Retensi Optimal Pada Optimisasi <i>Conditional Tail Expectation</i>	42
BAB IV STUDI KASUS.....	55
4.1 Deskripsi Data	55
4.2 Distribusi Data	56
4.3 Penentuan Retensi Optimal dengan <i>Value at Risk</i>	58
4.4 Penentuan Retensi Optimal dengan <i>Conditional Tail Expectation</i>	64
4.5 Risiko Reasuransi.....	67
4.6 Penentuan Retensi Optimal dengan Kasus Tertentu	69
BAB V KESIMPULAN	72
5.1 Kesimpulan	72
5.2 Saran.....	73
DAFTAR PUSTAKA	74
LAMPIRAN	77