

DAFTAR ISI

HALAMAN JUDUL.....	i
HALAMAN PENGESAHAN.....	ii
PERNYATAAN BEBAS PLAGIASI.....	iii
HALAMAN PERSEMBAHAN.....	iiiv
KATA PENGANTAR	v
DAFTAR ISI	vii
DAFTAR TABEL.....	x
DAFTAR GAMBAR	xi
DAFTAR LAMPIRAN.....	xii
INTISARI.....	xiii
<i>ABSTRACT</i>	xiv
BAB I	1
PENDAHULUAN	
1.1 Latar Belakang Masalah	1
1.2 Pembatasan Masalah.....	2
1.3 Tujuan dan Manfaat Penelitian	3
1.4 Metodologi Penelitian.....	4
1.5 Tinjauan Pustaka.....	4
1.6 Sistematika Penulisan	6
BAB II.....	8
DASAR TEORI	
2.1 Variabel Random	8
2.1.1 Variabel Random Diskrit.....	8
2.1.2 Variabel Random Kontinu.....	9
2.2 Karakteristik Variabel Random	10
2.2.1 Nilai Harapan.....	10
2.2.2 Variansi dan Standar Deviasi	11
2.2.3 Kovariansi.....	11
2.3 Distribusi Normal.....	12
2.4 Distribusi Gabungan	13

2.5	Variabel Random Independen.....	14
2.6	Distribusi Prediktif.....	15
2.7	Cadangan Klaim.....	16
2.8	Metode <i>Chain-Ladder</i>	17
2.9	<i>Generalized Linear Model</i>	18
2.10	<i>International Financial Reporting Standards 17</i>	19
BAB III.....		22
PEMODELAN BOOTSTRAP MACK DALAM CADANGAN KLAIM DAN PENYESUAIAN RISIKO VALUE-AT-RISK		
3.1	Penyesuaian Risiko Berdasarkan IFRS 17.....	22
3.2	Cadangan Klaim IBNR	24
3.3	Ukuran Ketidakpastian Cadangan Klaim.....	25
3.4	Pendekatan Berbasis Rumus Analitik.....	25
3.5	Model Mack	26
3.5.1	Segitiga <i>Run-Off</i> Kumulatif.....	26
3.5.2	Estimasi Cadangan	27
3.5.3	Estimator Parameter Model Mack.....	27
3.5.4	MSEP Model Mack	31
3.6	Pendekatan Berbasis Simulasi	35
3.7	Bootstrap Mack.....	36
3.7.1	Metode Bootstrap	36
3.7.2	Representasi Bootstrap Terhadap Model Mack	37
3.7.3	Prosedur Bootstrap Mack	38
3.8	Ukuran Risiko <i>Value-at-Risk</i>	42
BAB IV		45
IMPLEMENTASI PENYESUAIAN RISIKO DENGAN METODE BOOTSTRAP MACK DAN UKURAN RISIKO VALUE AT-RISK		
4.1	Deskripsi Data.....	45
4.2	Estimasi Cadangan dengan Model Mack.....	46
4.2.1	Prediksi IBNR	46
4.2.2	RMSEP	49
4.3	Estimasi Cadangan dengan Bootstrap Mack.....	50
4.3.1	Pembentukan Set Data Simulasi.....	51
4.3.2	Validasi Prosedur.....	57

4.4	Penyesuaian Risiko dengan Ukuran <i>Value-at-Risk</i>	58
4.4.1	Uji Normalitas	58
4.4.2	Perhitungan Penyesuaian Risiko	60
4.4.3	Interpretasi.....	61
4.4.4	Penyesuaian Risiko dan Laporan Keuangan	62
BAB V	64
PENUTUP		
5.1	Kesimpulan	64
5.2	Saran	65
DAFTAR PUSTAKA	67
LAMPIRAN	69