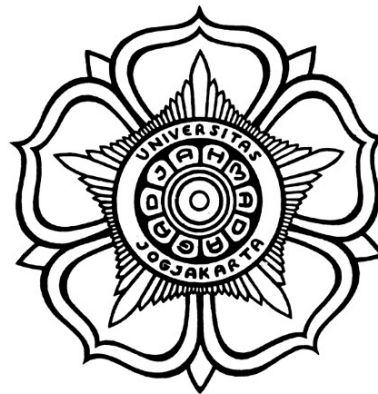


SKRIPSI

**OPTIMASI PENGELOLAAN RISIKO PASAR MODAL DAN RISIKO
LONGEVITY PADA PROGRAM PENSIUN MANFAAT PASTI: STRATEGI
LINDUNG NILAI LONGEVITY DAN BUY-IN**

**(OPTIMIZATION OF CAPITAL MARKET RISK AND LONGEVITY
RISK MANAGEMENT IN DEFINED BENEFIT PLANS: LONGEVITY
HEDGING AND BUY-IN STRATEGIES)**



Sifaur Rohmah
20/455435/PA/19650

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

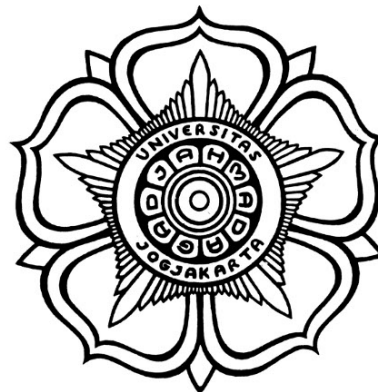
2024

SKRIPSI

OPTIMASI PENGELOLAAN RISIKO PASAR MODAL DAN RISIKO LONGEVITY PADA PROGRAM PENSIUN MANFAAT PASTI: STRATEGI LINDUNG NILAI *LONGEVITY* DAN *BUY-IN*

(*OPTIMIZATION OF CAPITAL MARKET RISK AND LONGEVITY RISK MANAGEMENT IN DEFINED BENEFIT PLANS: LONGEVITY HEDGING AND BUY-IN STRATEGIES*)

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



Sifaur Rohmah
20/455435/PA/19650

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

2024

HALAMAN PENGESAHAN

SKRIPSI

OPTIMASI PENGELOLAAN RISIKO PASAR MODAL DAN RISIKO LONGEVITY PADA PROGRAM PENSIUN MANFAAT PASTI: STRATEGI LINDUNG NILAI LONGEVITY DAN BUY-IN

Telah dipersiapkan dan disusun oleh

Sifauro Rohmah
20/455435/PA/19650

Telah dipertahankan di depan Tim Penguji
pada tanggal 3 Juli 2024

Susunan Tim Penguji



Dr. Adhitya Ronnie Effendie, S.Si., M.Si., M.Sc.
Pembimbing Utama




Dr. Drs. Gunardi, M.Si.
Ketua Tim Penguji

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



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



Dr. Noorma Yulia Megawati, S.Si., M.Sc., M.Act.Sc.
Penguji