PERHITUNGAN ESTIMASI PENYESUAIAN RISIKO UNTUK RISIKO NON-KEUANGAN IFRS 17 MENGGUNAKAN COLLECTIVE
RISK THEORY DAN SIMULASI MONTE CARLO DENGAN UKURAN RISIKO VALUE-AT-RISK, TAIL VALUE-AT-RISK, RANGE
VALUE-AT-RISK, DAN ENTROPIC VALUE-AT-RISK
Raka Daffaditya Wesnawa, Dr. Nanang Susyanto, S.Si., M.Sc., M.Act.Sc.
Universitas Gadjah Mada, 2026 | Diunduh dari http://etd.repository.ugm.ac.id/

SKRIPSI

PERHITUNGAN ESTIMASI PENYESUAIAN RISIKO UNTUK RISIKO NON-KEUANGAN IFRS 17 MENGGUNAKAN *COLLECTIVE RISK THEORY* DAN SIMULASI MONTE CARLO DENGAN UKURAN RISIKO *VALUE-AT-RISK*, *TAIL VALUE-AT-RISK*, *RANGE VALUE-AT-RISK*, DAN *ENTROPIC VALUE-AT-RISK*

(***CALCULATION OF RISK ADJUSTMENT ESTIMATION FOR NON-FINANCIAL RISK IFRS 17 USING COLLECTIVE RISK THEORY AND MONTE CARLO SIMULATION WITH VALUE-AT-RISK, TAIL VALUE-AT-RISK, RANGE VALUE-AT-RISK, AND ENTROPIC VALUE-AT-RISK RISK MEASURES*** **)**

Raka Daffaditya Wesnawa
21/477768/PA/20701

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

2026

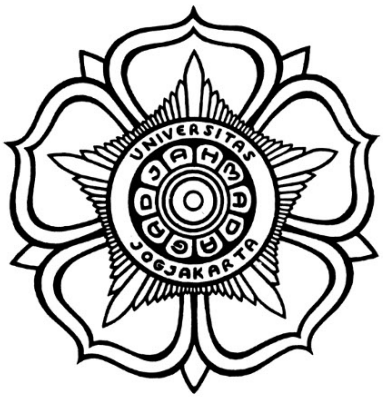
UNIVERSITAS
GADJAH MADA
PERHITUNGAN ESTIMASI PENYESUAIAN RISIKO UNTUK RISIKO NON-KEUANGAN IFRS 17 MENGGUNAKAN COLLECTIVE
RISK THEORY DAN SIMULASI MONTE CARLO DENGAN UKURAN RISIKO VALUE-AT-RISK, TAIL VALUE-AT-RISK, RANGE
VALUE-AT-RISK, DAN ENTROPIC VALUE-AT-RISK
Raka Daffaditya Wesnawa, Dr. Nanang Susyanto, S.Si., M.Sc., M.Act.Sc.
Universitas Gadjah Mada, 2026 | Diunduh dari http://etd.repository.ugm.ac.id/

SKRIPSI

PERHITUNGAN ESTIMASI PENYESUAIAN RISIKO UNTUK RISIKO NON-KEUANGAN IFRS 17 MENGGUNAKAN *COLLECTIVE RISK THEORY* DAN SIMULASI MONTE CARLO DENGAN UKURAN RISIKO *VALUE-AT-RISK*, *TAIL VALUE-AT-RISK*, *RANGE VALUE-AT-RISK*, DAN *ENTROPIC VALUE-AT-RISK*

(***CALCULATION OF RISK ADJUSTMENT ESTIMATION FOR NON-FINANCIAL RISK IFRS 17 USING COLLECTIVE RISK THEORY AND MONTE CARLO SIMULATION WITH VALUE-AT-RISK, TAIL VALUE-AT-RISK, RANGE VALUE-AT-RISK, AND ENTROPIC VALUE-AT-RISK RISK MEASURES*** **)**

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



Raka Daffaditya Wesnawa
21/477768/PA/20701

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

2026

UNIVERSITAS
GADJAH MADA
PERHITUNGAN ESTIMASI PENYESUAIAN RISIKO UNTUK RISIKO NON-KEUANGAN IFRS 17 MENGGUNAKAN COLLECTIVE
RISK THEORY DAN SIMULASI MONTE CARLO DENGAN UKURAN RISIKO VALUE-AT-RISK, TAIL VALUE-AT-RISK, RANGE
VALUE-AT-RISK, DAN ENTROPIC VALUE-AT-RISK
Raka Daffaditya Wesnawa, Dr. Nanang Susyanto, S.Si., M.Sc., M.Act.Sc.
Universitas Gadjah Mada, 2026 | Diunduh dari http://etd.repository.ugm.ac.id/

HALAMAN PENGESAHAN

SKRIPSI

PERHITUNGAN ESTIMASI PENYESUAIAN RISIKO UNTUK RISIKO NON-KEUANGAN IFRS 17 MENGGUNAKAN *COLLECTIVE RISK THEORY* DAN SIMULASI MONTE CARLO DENGAN UKURAN RISIKO *VALUE-AT-RISK*, *TAIL VALUE-AT-RISK*, *RANGE VALUE-AT-RISK*, DAN *ENTROPIC VALUE-AT-RISK*

Telah dipersiapkan dan disusun oleh

Raka Daffaditya Wesnawa
21/477768/PA/20701

Telah dipertahankan di depan Tim Penguji
pada tanggal 24 April 2026

Susunan Tim Penguji

Dr. Nanang Susyanto, S.Si., M.Sc., M.Act.Sc.
Pembimbing Utama

Dr. Solikhatun, S.Si., M.Si.
Ketua Tim Penguji

Prof. Dr. Abdurakhman, S.Si., M.Si.
Penguji

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

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