Perbandingan Retensi Optimal Reasuransi Stop-Loss Berdasarkan VaR dan TVaR pada Model Excess Loss
Berdistribusi Pareto Lomax
Fellanika Elroyna Simangunsong, Dr. Solikhatun, S.Si., M.Si.
Universitas Gadjah Mada, 2026 | Diunduh dari http://etd.repository.ugm.ac.id/

SKRIPSI

PERBANDINGAN RETENSI OPTIMAL REASURANSI *STOP-LOSS* BERDASARKAN VAR DAN TVAR PADA MODEL *EXCESS LOSS* BERDISTRIBUSI PARETO LOMAX

(*COMPARISON OF OPTIMAL STOP-LOSS REINSURANCE RETENTION BASED ON VAR AND TVAR UNDER THE EXCESS LOSS MODEL WITH PARETO LOMAX DISTRIBUTION*)

Fellanika Elroyna Simangunsong
22/494384/PA/21275

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

2026

Perbandingan Retensi Optimal Reasuransi Stop-Loss Berdasarkan VaR dan TVaR pada Model Excess Loss
Berdistribusi Pareto Lomax
Fellanika Elroyna Simangunsong, Dr. Solikhatun, S.Si., M.Si.
Universitas Gadjah Mada, 2026 | Diunduh dari http://etd.repository.ugm.ac.id/

SKRIPSI

PERBANDINGAN RETENSI OPTIMAL REASURANSI *STOP-LOSS* BERDASARKAN VAR DAN TVAR PADA MODEL *EXCESS LOSS* BERDISTRIBUSI PARETO LOMAX

(*COMPARISON OF OPTIMAL STOP-LOSS REINSURANCE RETENTION BASED ON VAR AND TVAR UNDER THE EXCESS LOSS MODEL WITH PARETO LOMAX DISTRIBUTION*)

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

Fellanika Elroyna Simangunsong
22/494384/PA/21275

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

2026

UNIVERSITAS
GADJAH MADA
**Perbandingan Retensi Optimal Reasuransi Stop-Loss Berdasarkan VaR dan TVaR pada Model Excess Loss
Berdistribusi Pareto Lomax**
Fellanika Elroyna Simangunsong, Dr. Solikhatun, S.Si., M.Si.
Universitas Gadjah Mada, 2026 | Diunduh dari http://etd.repository.ugm.ac.id/

HALAMAN PENGESAHAN

SKRIPSI

PERBANDINGAN RETENSI OPTIMAL REASURANSI *STOP-LOSS* BERDASARKAN VAR DAN TVAR PADA MODEL *EXCESS LOSS* BERDISTRIBUSI PARETO LOMAX

Telah dipersiapkan dan disusun oleh

Fellanika Elroyna Simangunsong
22/494384/PA/21275

Telah dipertahankan di depan Tim Penguji
pada tanggal 17 Juli 2026

Susunan Tim Penguji

Dr. Solikhatun, S.Si., M.Si.
Pembimbing Utama

Dr. Yunita Wulan Sari, S.Si., M.Sc.
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. Roto, M.Eng., Ph.D.
NIP. 196711171993031020