



DAFTAR ISI

HALAMAN JUDUL	i
HALAMAN PENGESAHAN	ii
HALAMAN PERNYATAAN.....	iii
HALAMAN MOTO DAN PERSEMBAHAN	iv
KATA PENGANTAR	v
DAFTAR ISI	vii
DAFTAR GAMBAR	ix
DAFTAR TABEL	x
DAFTAR LAMPIRAN.....	xi
INTISARI.....	xii
ABSTRACT	xiii
BAB I. PENDAHULUAN.....	1
1.1 Latar Belakang Masalah	1
1.2 Tujuan Penulisan	3
1.3 Pembatasan Masalah.....	3
1.4 Tinjauan Pustaka	4
1.5 Metode Penulisan	5
1.6 Sistematika Penulisan	5
BAB II. LANDASAN TEORI	7
2.1 Variabel Random dan Distribusinya.....	7
2.1.1 Variabel Random Diskrit.....	7
2.1.2 Variabel Random Kontinu.....	9
2.2 Distribusi Majemuk	15
2.3 Kuantil.....	15
2.4 Inferensi Bayesian	16
2.5 Model Distribusi Kerugian.....	21
2.5 Risiko Operasional.....	21
2.5.1 Definisi Risiko Operasional.....	21
2.5.2 Proses Manajemen Risiko Operasional.....	22
2.6 <i>Value at Risk</i> (VaR)	25
2.7 Simulasi Monte Carlo	25
BAB III. PEMODELAN STRUKTURAL RISIKO OPERASIONAL MELALUI INFERENSI BAYESIAN.....	27
3.1 Pemodelan Struktural Model Distribusi Kerugian Melalui Inferensi Bayesian	27
3.1.1 Pemodelan Distribusi Frekuensi	27
3.1.2 Pemodelan Distribusi Severitas	30
3.2 Estimasi Struktural Parameter Prior	34
3.2.1 Estimasi Struktural Parameter Prior Melalui <i>Pure Bayesian</i> <i>Approach</i>	34
3.2.2 Estimasi Struktural Parameter Prior Melalui <i>Empirical</i> <i>Bayesian Approach</i>	36



3.3 Perhitungan Estimasi Potensi Kerugian Risiko Operasional Melalui Model Distribusi Kerugian.....	38
BAB IV. STUDI KASUS	39
4.1 Deskripsi Data	39
4.2 Perangkat Lunak yang Digunakan.....	40
4.3 Pemodelan Struktural Model Distribusi Kerugian Melalui Inferensi Bayesian	40
4.3.1 Pemodelan Distribusi Frekuensi	41
4.3.2 Pemodelan Distribusi Severitas	49
4.4 Perhitungan Estimasi Potensi Kerugian Risiko Operasional Melalui Model Distribusi Kerugian.....	57
BAB V. PENUTUP	59
5.1 Kesimpulan	59
5.2 Saran	60
DAFTAR PUSTAKA	61
LAMPIRAN	63