

DAFTAR ISI

HALAMAN PENGESAHAN	iii
PERNYATAAN ORISINALITAS.....	iv
KATA PENGANTAR.....	v
DAFTAR TABEL	x
DAFTAR GAMBAR.....	xi
DAFTAR LAMPIRAN	xiii
INTISARI	xiv
ABSTRACT	xv
BAB I PENDAHULUAN.....	1
1.1.Latar Belakang.....	1
1.2. Tujuan Penelitian.....	3
1.3. Tinjauan Pustaka.....	3
1.4. Metode Penelitian	5
1.5. Sistematika Penulisan.....	5
BAB II LANDASAN TEORI	7
2.1. Variabel Random.....	7
2.2. Nilai Harapan, Variansi,Fungsi Pembangkit Momen dan Skewness	8
2.3. <i>Tail Weight</i>	9
2.4. Uji Anderson-Darling.....	11
2.5. Metode Maximum Likelihood.....	11
2.6. Obligasi.....	13
2.7. Proses Stokastik.....	15
2.8. <i>Counting Process</i>	17
2.9. Bunga.....	22
BAB III PENENTUAN HARGA OBLIGASI BENCANA ALAM DENGAN METODE PENDEKATAN INVERSE GAUSSIAN UNTUK TOTAL KERUGIAN.....	25
3.1.Deskripsi Obligasi Bencana Alam	25

3.2. Model Agregat Kerugian Bencana Alam	27
3.3. Model Suku Bunga Cox-Ingersoll-Ross (CIR)	38
3.4. Penerapan Model CIR dalam Penentuan Harga Obligasi Tanpa Kupon	52
3.5. Formulasi Nilai Obligasi Bencana Alam	65
BAB IV STUDI KASUS	70
4.1. Estimasi Parameter Model Suku Bunga CIR	71
4.2. Validasi Asumsi Proses Poisson Non Homogen	72
4.3. Estimasi Parameter Total Kerugian	75
4.4. Suku Bunga	78
4.5. Kerugian Agregat	78
4.6. Simulasi Harga Obligasi Bencana Alam Tanpa Kupon	80
4.7. Simulasi Harga Obligasi Bencana Alam Dengan Kupon	85
4.8. Rangkuman Sifat Obligasi Bencana Alam	99
BAB V SIMPULAN DAN SARAN	92
5.1. Simpulan	92
5.2. Saran	93
DAFTAR PUSTAKA	95
LAMPIRAN	98