

## Daftar Isi

HALAMAN JUDUL .....	ii
HALAMAN PENGESAHAN .....	iii
HALAMAN PERNYATAAN .....	iv
HALAMAN PERSEMBAHAN .....	v
KATA PENGANTAR .....	vi
DAFTAR ISI .....	viii
DAFTAR TABEL .....	x
DAFTAR GAMBAR .....	xi
DAFTAR LAMPIRAN .....	xii
INTISARI .....	xiii
ABSTRACT .....	xiv
<b>BAB I PENDAHULUAN</b>	
1.1 Latar Belakang Permasalahan .....	1
1.2 Tujuan Penulisan .....	3
1.3 Pembatasan Masalah .....	3
1.4 Tinjauan Pustaka .....	3
1.5 Metode Penulisan .....	4
1.6 Sistematika Penulisan .....	4
<b>BAB II LANDASAN TEORI</b>	
2.1 Variabel Random .....	6
2.2 Fungsi Massa dan Kepadatan Probabilitas .....	6
2.3 Karakteristik Distribusi Peluang .....	7
2.4 Distribusi dengan Ekor Gemuk ( <i>heavy-tailed</i> ) .....	7
2.5 Teori Nilai Ekstrem (Extrem Value Theory) .....	8
2.6 Pemodelan Generalized Pareto Distribution .....	8
2.7 Estimasi Maksimum Likelihood .....	13
2.8 Estimasi Method of Trimmed Moments (MTM) .....	15
2.8.1 Metode Momen ( <i>Method of Moments</i> ) .....	15
2.8.2 Method of Trimmed Moments ( <i>MTM</i> ) .....	17
2.9 Polis Asuransi .....	18
2.10 Risiko .....	18
2.11 Kuantil (Koenkoer, 2005) .....	22
2.12 Value at Risk .....	23
2.13 Backtesting .....	25
2.14 Kriteria Pemilihan .....	26
2.15 Forecasting .....	27
2.15.1 Beberapa metode <i>forecasting</i> .....	27
2.15.2 <i>Double exponential smoothing</i> .....	29

<b>BAB III <i>FITTING GENERALIZED PARETO DISTRIBUTION USING METHOD OF TRIMMED MOMENTS</i></b>	
3.1. Pemodelan Generalized Pareto Distributions	30
3.2. Estimasi Parameter	34
3.2.1. Maximum Likelihood	35
3.2.2. Method of Trimmed Moments	37
<b>BAB IV STUDI KASUS</b>	
4.1. Data Historis Januari 2005 – September 2015	43
4.1.1. Deskripsi Data	44
4.1.2. Pengujian Efek GPD	45
4.1.3. Estimasi MLE dengan software Easyfit	47
4.1.4. Estimasi dengan MTM	47
4.1.5. Perbandingan antara Estimasi MLE dengan MTM	49
4.1.6. Aplikasi Hasil Estimasi Parameter untuk Penghitungan VaR	49
4.1.7. Backtesting dengan Uji Kupiec	50
4.2. Data Historis Januari 2010 – September 2015	55
4.2.1. Deskripsi Data	56
4.2.2. Pengujian Efek GPD	57
4.2.3. Estimasi MLE dengan software Easyfit	59
4.2.4. Estimasi dengan MTM	59
4.2.5. Perbandingan antara Estimasi MLE dengan MTM	61
4.2.6. Aplikasi Hasil Estimasi Parameter untuk Penghitungan VaR	61
4.2.7. Backtesting dengan Uji Kupiec	62
<b>BAB V KESIMPULAN DAN SARAN</b>	
5.1. Kesimpulan	67
5.2. Saran	69
<b>DAFTAR PUSTAKA</b>	70
<b>LAMPIRAN</b>	72