

DAFTAR ISI

LEMBAR PERSETUJUAN.....	i
LEMBAR PERNYATAAN.....	ii
Abstrak.....	iii
Abstract.....	iv
LEMBAR PERSEMBAHAN.....	v
KATA PENGANTAR.....	vi
DAFTAR ISI.....	vii
DAFTAR GAMBAR.....	ix
DAFTAR TABEL.....	x
BAB 1 PENDAHULUAN.....	1
1.1. Latar Belakang.....	1
1.2. Rumusan Masalah.....	2
1.3. Tujuan	2
1.4. Metode Penelitian.....	2
1.5. Hipotesis.....	3
BAB 2 TINJAUAN PUSTAKA.....	4
2.1. Extreme Value Theory.....	4
2.2. Generalized Pareto Distribution.....	5
2.3. Distribusi Eksponensial.....	5
2.4. Mixture Distribution.....	6
2.5. Asuransi.....	6
2.6. Klaim Asuransi.....	6
2.7. Value-at-Risk.....	7

BAB 3 PERANCANGAN SISTEM.....	8
3.1. Data.....	9
3.2. Mencari Threshold.....	9
3.3. Fitting PDF Mixture dengan Data.....	9
3.4. Analisis Data Ekstrim	9
BAB 4 HASIL ANALISIS DAN PENGUJIAN.....	10
4.1. Estimasi Parameter.....	10
4.1.1 Threshold.....	10
4.1.2 Generalized Pareto Distribution.....	11
4.1.3 Mixture Exponential.....	13
4.2. Data Fitting.....	14
4.2.1 Mixture Exponential Dengan Satu lambda.....	14
4.2.2 Mixture Exponential Dengan dua lambda.....	15
4.3. Value-at-Risk.....	16
4.4. Uji Validasi VaR.....	19
BAB 5 KESIMPULAN DAN SARAN.....	22
5.1. Kesimpulan.....	22
5.2. Saran.....	22
DAFTAR PUSTAKA	23
LAMPIRAN 1.....	24
L.1.1. Data Klaim asuransi.....	24
LAMPIRAN 2.....	28
L.2.1. Kode Matlab PDF EVT Via Mixture Exponential.....	28
L.2.2. Kode Matlab Untuk Generate Pareto.....	29

L.2.3. Kode Matlab Untuk Plot Data Ekstrim	29
L.2.4. Kode Matlab Untuk Mencari VaR	29