

DAFTAR ISI

HALAMAN JUDUL	i
HALAMAN PERSEMBAHAN	ii
HALAMAN MOTTO	iii
PRAKATA	iv
DAFTAR ISI	vi
DAFTAR TABEL	viii
DAFTAR GAMBAR	ix
DAFTAR LAMBANG	xi
INTISARI	xii
ABSTRACT	xiii
I PENDAHULUAN	1
1.1. Latar Belakang Masalah	1
1.2. Perumusan Masalah	2
1.3. Tujuan Penelitian	2
1.4. Tinjauan Pustaka	2
1.5. Metodologi Penelitian	3
1.6. Sistematika Penulisan	4
II DASAR TEORI	5
2.1. Ekspektasi dan Variansi pada Variabel Random	5
2.2. Distribusi Poisson	7
2.3. Distribusi Normal	8
2.4. Distribusi <i>Lognormal</i>	9
2.5. Keluarga Eksponensial	9
2.6. Model Linier Tergeneralisasi	10
2.6.1. Fungsi Penghubung	11
2.7. Asuransi	12
2.8. Metode <i>Mack Chain Ladder</i>	14
2.9. Model Stokastik <i>Chain Ladder</i>	16
2.10. Cadangan Klaim model <i>Over-Dispersed Poisson</i>	19
2.10.1. Estimasi Cadangan Klaim model <i>Over-Dispersed Poisson</i>	20
2.10.2. Nilai <i>Standard Error</i>	23
III GENERALIZED LOGNORMAL CHAIN LADDER	24
3.1. Cadangan Klaim dengan Metode <i>Lognormal</i>	24

3.1.1.	Asumsi Metode <i>Lognormal</i>	24
3.1.2.	Estimasi Cadangan Klaim Metode <i>Lognormal</i>	25
3.2.	<i>Generalized Lognormal Chain Ladder</i>	32
3.2.1.	<i>Infinite Divisible</i>	32
3.2.2.	Asumsi Metode <i>Generalized Lognormal Chain Ladder</i>	32
3.3.	Estimasi Distribusi Cadangan Klaim	38
3.4.	Nilai Total Estimasi Cadangan Klaim	39
3.5.	Nilai <i>Standard Error</i>	41
IV	STUDI KASUS	42
4.1.	Karakteristik Data	42
4.2.	Perhitungan Cadangan Klaim Model <i>Over-Dispersed Poisson</i>	43
4.2.1.	Asumsi Model <i>Over-Dispersed Poisson</i>	44
4.2.2.	Perhitungan Estimasi Cadangan Klaim dengan MLE	44
4.2.3.	Perhitungan Estimasi Cadangan Klaim dengan GLM	46
4.3.	Perhitungan Cadangan Klaim Metode <i>Generalized Lognormal</i>	49
4.3.1.	Asumsi Metode <i>Generalized Lognormal</i>	49
4.3.2.	Perhitungan Estimasi Cadangan Klaim dengan MLE	51
4.3.3.	Perhitungan Estimasi Cadangan Klaim dengan GLM	54
4.4.	Perbandingan Hasil Cadangan Klaim	56
V	PENUTUP	59
5.1.	Kesimpulan	59
5.2.	Saran	59
	DAFTAR PUSTAKA	61
A	Sintaks Estimasi Cadangan Klaim dengan Model <i>Over-Dispersed Poisson</i>	64
B	Sintaks Estimasi Cadangan Klaim dengan Metode <i>Generalized Lognormal</i>	65
C	Perhitungan Estimasi Klaim Segitiga <i>Run-Off</i> Bawah dengan Metode <i>Over-Dispersed Poisson</i>	67