

DAFTAR ISI

HALAMAN JUDUL	i
HALAMAN PENGESAHAN	ii
HALAMAN PERNYATAAN	iii
HALAMAN PERSEMBAHAN	iv
HALAMAN MOTTO	v
PRAKATA	vi
DAFTAR ISI	viii
DAFTAR TABEL	xi
DAFTAR GAMBAR	xii
DAFTAR LAMBANG	xiii
INTISARI	xiv
ABSTRACT	xv
I PENDAHULUAN	1
1.1. Latar Belakang Masalah	1
1.2. Tujuan dan Manfaat Penelitian	3
1.3. Batasan Penelitian	4
1.4. Tinjauan Pustaka	4
1.5. Metodologi Penelitian	7
1.6. Sistematika Penulisan	8
II DASAR TEORI	9
2.1. Variabel Random	9
2.1.1. Variabel Random Diskrit	9
2.1.2. Variabel Random Kontinu	10
2.2. Variabel Random Independen	10
2.3. Nilai Ekspetasi	10
2.4. Ekspetasi Bersyarat	11
2.5. Beberapa Distribusi Variabel Random Kontinu	11
2.5.1. Distribusi Uniform	11
2.5.2. Distribusi Gamma	12
2.5.3. Disribusi <i>Generalized Pareto</i>	12
2.5.4. Distribusi Normal	13
2.5.5. Distribusi Lognormal	13
2.5.6. Distribusi Weibull	14

2.6.	Distribusi Probabilitas Gabungan	15
2.6.1.	Distribusi Probabilitas Gabungan Diskrit	15
2.6.2.	Distribusi Probabilitas Gabungan Kontinu	15
2.7.	Distribusi Probabilitas Marginal	16
2.7.1.	Distribusi Probabilitas Marginal Diskrit	16
2.7.2.	Distribusi Probabilitas Marginal Kontinu	16
2.8.	Distribusi Probabilitas Bersyarat	16
2.9.	ECDF (<i>Empirical Cumulative Distribution Function</i>)	17
2.10.	Uji <i>Goodness of Fit</i> Kolmogorov-Smirnov	18
2.11.	Likelihood	18
2.11.1.	Fungsi Likelihood	18
2.11.2.	<i>Maximum Likelihood Estimator</i>	18
2.12.	BIC (<i>Bayesian Information Criterion</i>)	19
2.13.	Konsep Dependensi	20
2.14.	Ukuran Dependensi	20
2.14.1.	Korelasi Pearson	20
2.14.2.	Korelasi Peringkat	21
2.15.	IFRS (<i>International Financial Reporting Standard</i>) 17	23
III	ESTIMASI <i>BEST ESTIMATE LIABILITY</i> UNTUK <i>LIABILITY FOR INCURRED CLAIM</i> PRODUK ASURANSI MENGGUNAKAN SIMULASI COPULA	25
3.1.	Copula	25
3.2.	Copula Archimedean	27
3.2.1.	Sifat-sifat Copula Archimedean	28
3.2.2.	Keluarga Copula Archimedean	28
3.3.	Estimasi Parameter Copula	40
3.4.	Menentukan Copula Archimedean Terbaik	41
3.5.	Simulasi Monte-Carlo	41
3.6.	BEL (<i>Best Estimate Liability</i>)	42
IV	STUDI KASUS	45
4.1.	Data	45
4.2.	Penentuan Distribusi Variabel	48
4.3.	Estimasi Copula Archimedean	51
4.4.	Estimasi <i>Best Estimate Liability</i>	53
V	PENUTUP	58
5.1.	Kesimpulan	58

5.2. Saran	58
DAFTAR PUSTAKA	60
A Program Python	63