

## DAFTAR ISI

<b>HALAMAN JUDUL</b>	<b>i</b>
<b>HALAMAN PENGESAHAN</b>	<b>ii</b>
<b>HALAMAN PERNYATAAN</b>	<b>iii</b>
<b>HALAMAN PERSEMBAHAN</b>	<b>iv</b>
<b>HALAMAN MOTTO</b>	<b>v</b>
<b>PRAKATA</b>	<b>vi</b>
<b>DAFTAR ISI</b>	<b>viii</b>
<b>DAFTAR TABEL</b>	<b>x</b>
<b>DAFTAR GAMBAR</b>	<b>xi</b>
<b>DAFTAR LAMBANG</b>	<b>xii</b>
<b>INTISARI</b>	<b>xiii</b>
<b>ABSTRACT</b>	<b>xiv</b>
<b>I PENDAHULUAN</b>	<b>1</b>
1.1. Latar Belakang dan Perumusan Masalah	1
1.2. Tujuan dan Manfaat Penelitian	4
1.3. Tinjauan Pustaka	5
1.4. Metodologi dan Tahap Pelaksanaan Penelitian	7
1.5. Sistematika Penulisan	10
<b>II DASAR TEORI</b>	<b>11</b>
2.1. Variabel Random	11
2.2. Fungsi Kepadatan Peluang (pdf) dan Fungsi Distribusi Kumulatif (CDF)	12
2.3. Mean, Variansi, dan Fungsi Survival	13
2.4. Distribusi Lognormal	16
2.5. Sistem Asuransi dan Reasuransi	18
2.6. Reasuransi <i>Quota-share</i> dan Retensinya	20
2.7. Prinsip Perhitungan Premi	21
2.8. Prinsip Variansi dalam Premi Reasuransi	22
2.9. Kekayaan Perusahaan Asuransi	23
2.10. Fungsi Utilitas dan Nilai Ekspektasi Utilitas	24
2.11. Fungsi Utilitas Penghindaran Risiko Relatif Konstan ( <i>Constant Relative Risk Aversion</i> )	25
2.12. Ukuran Risiko <i>Value at Risk</i>	26

2.13. Fungsi Konveks dan Masalah Optimisasi Konveks . . . . .	27
2.14. Permasalahan Optimisasi Multi Objektif ( <i>Multi-objective Optimization Problem</i> ) . . . . .	28
<b>III PENENTUAN RETENSI OPTIMAL REASURANSI <i>QUOTA-SHARE</i></b>	<b>31</b>
3.1. Optimisasi <i>Value at Risk</i> dan Ekspektasi Utilitas . . . . .	31
3.2. Kriteria dan Model Optimisasi Retensi . . . . .	33
3.3. Solusi Optimal Retensi Reasuransi . . . . .	35
<b>IV RETENSI OPTIMAL REASURANSI <i>QUOTA-SHARE</i> PADA DATA KLA- IM PERUSAHAAN ASURANSI</b>	<b>39</b>
4.1. Data . . . . .	40
4.2. <i>Preprocessing</i> Data . . . . .	41
4.3. Analisis Deskriptif dan Distribusi Data . . . . .	42
4.4. Penentuan Retensi Optimal Data . . . . .	47
4.5. Analisis Sensitivitas terhadap Parameter Model . . . . .	51
4.6. Interpretasi Retensi Optimal Reasuransi . . . . .	54
<b>V PENUTUP</b>	<b>60</b>
5.1. Kesimpulan . . . . .	60
5.2. Saran . . . . .	62
<b>DAFTAR PUSTAKA</b>	<b>63</b>
<b>A Syntax RStudio</b>	<b>65</b>