

DAFTAR ISI

HALAMAN JUDUL	i
HALAMAN PENGESAHAN	ii
HALAMAN PERNYATAAN BEBAS PLAGIASI	iii
HALAMAN PERSEMBAHAN	iv
HALAMAN MOTTO	v
PRAKATA	vi
DAFTAR ISI	viii
DAFTAR TABEL	x
DAFTAR GAMBAR	xi
DAFTAR LAMBANG	xii
INTISARI	xiii
ABSTRACT	xiv
I PENDAHULUAN	1
1.1 Latar Belakang Masalah	1
1.2 Tujuan dan Manfaat Penelitian	3
1.3 Tinjauan Pustaka	4
1.4 Metodologi Penelitian	6
1.5 Sistematika Penulisan	7
II DASAR TEORI	9
2.1 Variabel Random	9
2.2 Fungsi Kepadatan Peluang (pdf) dan Fungsi Distribusi Kumulatif (CDF)	10
2.3 Mean, Variansi, dan Fungsi Survival	12
2.4 Distribusi Normal	18
2.5 Distribusi Gamma	19
2.6 Distribusi Weibull	21
2.7 Distribusi Lognormal	22
2.8 Sistem Asuransi dan Reasuransi	25
2.9 Reasuransi <i>Quota-Share</i> dan Retensinya	27
2.10 Prinsip Perhitungan Premi Reasuransi	28
2.11 Prinsip Variansi dalam Premi Reasuransi	30
2.12 Ukuran Risiko Value at Risk	31
2.13 Fungsi Konveks dan Masalah Optimisasi Konveks	32

2.14	Permasalahan Optimisasi Multi Objektif (<i>Multi-objective Optimization Problem</i>)	34
2.15	Kriteria Informasi Akaike (AIC)	36
2.16	Kriteria Informasi Bayesian (BIC)	37
III	PENENTUAN RETENSI OPTIMAL QUOTA SHARE PADA KONTRAK REASURANSI	39
3.1	Optimasi <i>Value at Risk</i>	39
3.2	Kriteria dan Model Optimisasi	41
3.3	Solusi Optimal Retensi Reasuransi	43
IV	RETENSI OPTIMAL REASURANSI QUOTA-SHARE PADA DATA KLAIM PERUSAHAAN ASURANSI	50
4.1	Data	51
4.2	<i>Pre-processing</i> Data	52
4.3	Analisis Distribusi Data	52
4.4	Penentuan Retensi Optimal pada Data	55
4.5	Analisis Sensitivitas terhadap Parameter Model	61
4.6	Interpretasi Retensi Optimal Reasuransi	64
V	PENUTUP	69
5.1	Kesimpulan	69
5.2	Saran	71
	DAFTAR PUSTAKA	72
A	PROGRAM R	74