

## DAFTAR ISI

<b>HALAMAN JUDUL</b> . . . . .	<b>i</b>
<b>HALAMAN PENGESAHAN</b> . . . . .	<b>ii</b>
<b>HALAMAN PERNYATAAN BEBAS PLAGIASI</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>INTISARI</b> . . . . .	<b>x</b>
<b>ABSTRACT</b> . . . . .	<b>xi</b>
<b>I PENDAHULUAN</b> . . . . .	<b>1</b>
1.1 Latar Belakang Masalah . . . . .	1
1.2 Tujuan dan Manfaat Penelitian . . . . .	3
1.3 Batasan Masalah . . . . .	3
1.4 Tinjauan Pustaka . . . . .	3
1.5 Metode Penelitian . . . . .	5
1.6 Sistematika Penulisan . . . . .	5
<b>II DASAR TEORI</b> . . . . .	<b>7</b>
2.1 Teori Probabilitas . . . . .	7
2.2 Variabel Random . . . . .	8
2.2.1 Variabel Random Diskrit . . . . .	8
2.2.2 Variabel Random Kontinu . . . . .	9
2.2.3 Distribusi Gabungan . . . . .	9
2.2.4 Distribusi Marginal . . . . .	10
2.2.5 Distribusi Bersyarat . . . . .	10
2.3 Konsep Dependensi . . . . .	11
2.4 Segitiga <i>Run-Off</i> . . . . .	11
2.5 Cadangan Klaim . . . . .	12
2.6 Copula . . . . .	14
2.7 Copula Archimedean . . . . .	18
2.8 Penentuan Copula Terbaik . . . . .	21
2.9 Metode <i>Conditional Least Square</i> . . . . .	21
2.10 Likelihood . . . . .	22
2.10.1 Fungsi Likelihood . . . . .	22

2.10.2	Metode <i>Maximum Likelihood Estimation</i> . . . . .	22
2.10.3	Metode Quasi Likelihood . . . . .	23
2.10.4	Estimasi Quasi Likelihood . . . . .	24
2.11	Metode Bootstrap . . . . .	24
<b>III ESTIMASI CADANGAN KLAIM MENGGUNAKAN COPULA AR- CHIMEDEAN DAN METODE <i>CONDITIONAL LEAST SQUARE</i> . .</b>		<b>26</b>
3.1	Model <i>Conditional Mean and Variance</i> (CMV) . . . . .	26
3.2	Fungsi Copula . . . . .	28
3.3	Keluarga Copula . . . . .	29
3.4	Dependensi Eror . . . . .	32
3.5	Estimasi Parameter . . . . .	33
3.5.1	Estimasi Model <i>Conditional Mean and Variance</i> (CMV) . .	33
3.5.2	Estimasi Struktur Dependensi . . . . .	36
3.6	Prediksi Cadangan . . . . .	38
<b>IV STUDI KASUS . . . . .</b>		<b>40</b>
4.1	Data . . . . .	40
4.2	Estimasi Cadangan Klaim . . . . .	42
4.3	Perbandingan Metode Estimasi Cadangan Klaim . . . . .	48
<b>V PENUTUP . . . . .</b>		<b>51</b>
5.1	Kesimpulan . . . . .	51
5.2	Saran . . . . .	51
<b>DAFTAR PUSTAKA . . . . .</b>		<b>53</b>