



DAFTAR ISI

SAMPUL LUAR.....	i
HALAMAN JUDUL.....	ii
HALAMAN PENGESAHAN.....	iii
HALAMAN PERNYATAAN.....	iv
HALAMAN PERSEMBAHAN.....	v
PRAKATA.....	vi
DAFTAR ISI.....	viii
DAFTAR GAMBAR.....	x
DAFTAR TABEL.....	xi
DAFTAR LAMPIRAN.....	xii
INTISARI.....	xiii
ABSTRACT.....	xiv
BAB I PENDAHULUAN.....	1
1.1 Latar Belakang.....	1
1.2 Tujuan Penelitian.....	3
1.3 Pembatasan Masalah.....	4
1.4 Metode Penulisan.....	4
1.5 Tinjauan Pustaka.....	5
1.6 Sistematika Penulisan.....	6
BAB II DASAR TEORI.....	7
2.1 Probabilitas.....	7
2.1.1 Definisi probabilitas.....	7
2.1.2 Probabilitas bersyarat.....	7
2.2 Variabel Random.....	7
2.2.1 Definisi variabel <i>random</i>	7
2.2.2 Variabel <i>random</i> diskrit.....	8
2.2.3 Variabel <i>random</i> kontinu.....	8
2.2.4 Distribusi gabungan.....	8
2.2.5 Distribusi marginal.....	9
2.2.6 Distribusi bersyarat.....	10
2.3 Karakteristik Variabel <i>Random</i>	10
2.3.1 Harga harapan.....	10
2.3.2 Harga harapan bersyarat.....	11
2.3.3 Harga harapan untuk <i>pdf</i> gabungan.....	11
2.3.4 Variansi.....	11
2.3.5 Variabel <i>random</i> independen.....	12
2.4 Distribusi Univariat.....	12
2.4.1 Distribusi normal.....	12
2.4.2 Distribusi gamma.....	15
2.4.3 Distribusi Poisson.....	17
2.4.4 Distribusi <i>zero truncated Poisson</i>	18



2.5	Ukuran Dependensi	22
2.6	Korelasi Linear	22
2.7	Korelasi Kendall Tau	23
2.8	Distribusi Frekuensi Klaim	24
2.9	Distribusi <i>Severity</i> Klaim	25
2.10	Teorema <i>Sklar</i>	25
2.11	<i>Copula</i>	27
2.11.1	Pengertian <i>copula</i>	27
2.11.2	Sifat-sifat <i>copula</i>	27
2.12	<i>Maximum Likelihood Estimation</i>	27
2.13	Model Linear Tergeneralisasi	28
2.13.1	Keluarga Eksponensial	30
2.13.2	Fungsi link	32
BAB III ESTIMASI TOTAL LOSS MENGGUNAKAN REGRESI BERBASIS COPULA		33
3.1	<i>Copula Archimedean</i>	33
3.1.1	Anggota <i>copulaarchimedean</i>	35
3.2	<i>CopulaElliptical</i>	37
3.2.1	Anggota <i>copulaelliptical</i>	37
3.3	Pemilihan <i>Copula</i>	39
3.4	Bivariat <i>Copula</i> untuk Data Kontinue dan Diskrit	41
3.5	Distribusi Marjinal untuk Frekuensi dan <i>Severity</i> Klaim	43
3.6	Model <i>Copula</i> untuk Frekuensi dan <i>Severity</i> Klaim	43
3.7	Estimasi Kerugian Polis	44
3.8	Model Regresi <i>Copula</i> untuk Frekuensi dan <i>Severity</i> Klaim	45
3.8.1	Formula model	45
3.8.2	Estimasi parameter	46
3.8.3	Seleksi model <i>copula</i>	48
3.9	Estimasi dari Total <i>Loss</i>	48
BAB IV STUDI KASUS		50
4.1	Deskripsi Data	50
4.2	Uji Korelasi	43
4.3	Model Marginal Frekuensi Klaim	54
4.4	Model Marginal <i>Severity</i> Klaim	55
4.5	Hasil Pemilihan <i>Copula</i> Clayton dan Gaussian	56
4.6	Estimasi Parameter Model Independen dan Model <i>Copula</i>	59
4.7	Prediksi <i>Severity</i> dan Frekuensi Klaim	60
BAB V PENUTUP		64
5.1	Kesimpulan	64
5.2	Saran	64
DAFTAR PUSTAKA		66