Universitas Indonesia Library >> UI - Skripsi Membership

Probabilitas ruin pada proses surplus

Deskripsi Lengkap: https://lib.ui.ac.id/detail?id=20180932&lokasi=lokal

---

Abstrak

Tugas akhir ini bertujuan menentukan probabilitas ruin yang digunakan sebagai salah satu ukuran risiko keuangan perusahaan asuransi. Dibahas perhitungan probabilitas ruin melalui rumus langsung dan melalui variabel random maximal aggregate loss. Untuk perhitungan probabilitas ruin melalui rumus langsung dibahas hubungan antara probabilitas ruin dengan koefisien penyesuai dalam suatu persamaan. Dari persamaan tersebut dapat ditentukan batas atas dari probabilitas ruin. Sedangkan perhitungan probabilitas ruin melalui variabel random maximal aggregate loss, probabilitas ruin dapat dihitung melalui fungsi survival dari maximal aggregate loss. Selanjutnya, dengan menggunakan fungsi pembangkit momen dari maximal aggregate loss akan dicari probabilitas ruin pada besar klaim berdistribusi campuran dari dua distribusi eksponensial.