

Distribusi bersama dari surplus sesaat sebelum Ruin dan Defisit saat Ruin untuk klaim yang berkorelasi waktu

Deskripsi Lengkap: <https://lib.ui.ac.id/detail?id=20180970&lokasi=lokal>

Abstrak

Dalam tugas akhir ini, akan dibahas mengenai distribusi bersama dari surplus sesaat sebelum ruhin dan defisit saat ruhin untuk klaim yang berkorelasi waktu. Kadang-kadang suatu klaim yang diajukan dapat memicu munculnya klaim lain sehingga terdapat korelasi waktu antara klaim-klaim tersebut. Klaim pemicu biasanya disebut main claim dan klaim yang dipicu disebut by claim. Dengan menggunakan proses surplus baru, law of total probability, dan fungsi pembangkit probabilitas (generating function) akan diperoleh distribusi bersama dari surplus sesaat sebelum ruhin dan defisit saat ruhin untuk klaim yang berkorelasi waktu. Skripsi ini juga akan membahas mengenai penggunaan distribusi tersebut terhadap main claim dan by claim yang berdistribusi geometri.