



UNIVERSITAS BRAWIJAYA MALANG
FAKULTAS MATEMATIKA DAN ILMU PENGETAHUAN ALAM
JURUSAN MATEMATIKA
Program Studi Matematika
Rencana Program dan Kegiatan Pembelajaran Semester
(RPKPS)
TEORI RESIKO

Matakuliah	MAM 4248 TEORI RESIKO
sks	2
Prasyarat	MAM 4145 PROSES STOKASTIK
Tujuan	Memberikan pemahaman tentang prinsip-prinsip resiko dan aplikasinya
Silabus	Model peluang dalam proses resiko, model resiko individu, model resiko kolektif, estimasi distribusi resiko, teori ruin.
Buku Rujukan	<ol style="list-style-type: none"> 1. Harry H. Panjer and Gordon E. Willmot, 1992, <i>Insurance Risk Models</i>, Society of Actuaries. 2. Newton L. Bower, Hans U. Gerber dkk, 1997, <i>Actuarial Mathematics</i>, Society of Actuaries. 3. Hans U Gerber, <i>Life Insurance Mathematics</i>, 1997, Springer, 3rd edition, Swiss.
Evaluasi	Nilai akhir merupakan gabungan dari nilai-nilai berikut ini dengan pembobotan tertentu. <ol style="list-style-type: none"> 1. Ujian Tengah Semester (UTS) 2. Ujian Akhir Semester (UAS) 3. KUIS 4. Tugas

Pertemuan Ke-	Topik Bahasan	Keterangan
01	Kontrak Perkuliahan, <i>review</i> distribusi peluang, proses stokastik.	
02	Latihan soal pertemuan ke 1 dan pemberian tugas 1.	
03	Pengantar model resiko individu, Aproksimasi distribusi total klaim	
04	Latihan soal pertemuan ke 3 dan pemberian tugas 2.	
05	Lanjutan model resiko individu, Metode penghitungan total klaim : perhitungan langsung, perhitungan rekursif.	
06	Latihan soal pertemuan ke 5 dan pemberian tugas 3.	
07	Pengantar model resiko kolektif, Distribusi <i>Compound Poisson</i> dan resiko <i>Compound Poisson</i> .	

08	KUIS I	
09	Lanjutan model resiko kolektif & Latihan soal	
10	Lanjutan Resiko dari <i>Compound Poisson</i> , Latihan soal resiko <i>Compound Poisson</i> dan pemberian tugas 4.	
11	Pengantar pencocokan model resiko. Metode estimasi.	
12	Test kecocokan model, Ad Hoc estimasi dan Maksimum Likelihood estimasi.	
13	Pengantar teori ruin, Peluang ruin	
14	Latihan soal pertemuan ke 13 dan pemberian tugas 5	
15	Aplikasi teori resiko	
16	KUIS II	