

DAFTAR ISI

ABSTRAK	v
ABSTRACT	vi
KATA PENGANTAR	vii
DAFTAR LAMPIRAN	xii
DAFTAR GAMBAR	xiii
DAFTAR TABEL	xiv
DAFTAR SIMBOL	xv
1 PENDAHULUAN	1
1.1 Latar Belakang	1
1.2 Rumusan Masalah	3
1.3 Batasan Masalah	3
1.4 Tujuan dan Manfaat Penelitian	3
1.5 Metode Penelitian	4
1.6 Sistematika Penulisan	4
2 LANDASAN TEORI	6
2.1 Statistika Inferensial	6
2.1.1 Parameter dan Estimasi Parameter	6
2.1.2 Estimasi Parameter Klasik (<i>Frequentist</i>)	8
2.1.3 Estimasi Parameter Bayesian	9
2.2 Statistika Parametrik dan Statistika Nonparametrik	11
2.3 Korelasi	12
2.4 Copula	12
2.4.1 Teorema Sklar	14
2.4.2 <i>Probability Integral Transform</i> (PIT)	15
2.5 Copula Keluarga Archimedean	17
2.5.1 Copula Clayton	17
2.5.2 Copula Gumbel	18

2.5.3	Copula Frank	18
2.5.4	Copula Joe	19
2.5.5	Copula Ali Mikhail-Haq	19
2.6	Kendall Tau	20
2.7	Metode <i>Jitters</i>	22
2.8	Pengujian Hipotesis	23
3	ANALISIS COPULA ARCHIMEDEAN MELALUI TRANSFORMASI METODE <i>JITTERS</i>	25
3.1	Data <i>Jitters</i> Mepresentasikan Data Sebenarnya	25
3.1.1	<i>Jitters</i> Mempertahankan Orde Konkordan Data	25
3.1.2	<i>Jitters</i> Mempertahankan Kendall Tau	26
3.2	Kontruksi Copula Archimedean pada Data Hasil <i>Jitters</i>	27
3.2.1	Kontruksi Copula Clayton	27
3.2.2	Kontruksi Copula Gumbel	28
3.2.3	Kontruksi Copula Frank	29
3.2.4	Kontruksi Copula Joe	30
3.2.5	Kontruksi Copula Ali Mikhail-Haq	31
3.3	Estimasi Parameter Copula Keluarga Archimedean dengan Pendekatan Kendall Tau	32
3.3.1	Estimasi Parameter Copula Clayton	34
3.3.2	Estimasi Parameter Copula Gumbel	35
3.3.3	Estimasi Parameter Copula Frank	36
3.3.4	Estimasi Parameter Copula Joe	37
3.3.5	Estimasi Parameter Copula Ali Mikhail-Haq	38
3.4	Nonparametrik Copula (<i>Empirical Copula</i>)	39
3.5	<i>Goodness of Fit</i> Copula dengan Pendekatan <i>Empirical Copula</i>	40
3.6	Langkah-langkah Analisis	42
4	STUDI KASUS DAN ANALISA	45
4.1	Data	46
4.2	<i>Resampling</i> Data	47
4.3	Distribusi Data	48
4.3.1	Distribusi Data Frekuensi Klaim HIC	49
4.3.2	Distribusi Data Frekuensi Klaim CIC	50
4.4	Transformasi Metode <i>Jitter</i>	52
4.5	Analisis Data	53
4.5.1	Hitung Koefisien Kendall Tau	53
4.5.2	Transformasi Pseudo Observasi	53

4.5.3	Estimasi Parameter Copula Archimedean	54
4.5.4	Hitung Distribusi Bivariat Copula Archimedean	54
4.5.5	Pengujian Hipotesis	55
4.5.6	Hitung <i>Empirical Copula</i>	56
4.5.7	Uji <i>Goodness of Fit</i>	58
4.6	Hasil Analisis	59
5	KESIMPULAN DAN SARAN	61
5.1	Kesimpulan	61
5.2	Saran	63
	DAFTAR PUSTAKA	64
	LAMPIRAN	

