

Proses konstruksi fungsi survival copula pada distribusi bivariat eksponensial marshall-olkin.

Deskripsi Lengkap: <https://lib.ui.ac.id/detail?id=20180872&lokasi=lokal>

Abstrak

Pada tahun 1959, Sklar mengemukakan suatu teorema yang menjelaskan bahwa apabila terdapat suatu fungsi distribusi bivariat dan fungsi distribusi marginal, maka akan diperoleh suatu fungsi yang dikenal dengan copula yang dapat menghubungkan fungsi distribusi bivariat dan fungsi-fungsi distribusi marginalnya. Skripsi ini bertujuan untuk menjelaskan proses konstruksi famili copula yaitu fungsi copula yang melibatkan parameter berdasarkan distribusi bivariat eksponensial yang diturunkan oleh Marshall dan Olkin. Penurunan distribusi bivariat eksponensial Marshall- Olkin melibatkan suatu proses poisson tentang kedatangan shock pada sebuah sistem dengan 2 komponen. Kedatangan shock dianggap mengikuti fatal shock model, di mana kedatangan shock dapat berakibat fatal bagi komponen secara spontan. Fungsi copula yang terbentuk merupakan fungsi survival copula, yakni fungsi yang menghubungkan fungsi survival bivariat dengan fungsi-fungsi survival marginalnya. Pada tugas akhir ini juga akan dikaji suatu ilustrasi yang menggambarkan fenomena yang terjadi dalam proses konstruksi fungsi survival copula Marshall-Olkin.