Universitas Indonesia Library >> UI - Skripsi Membership

Metode inference functions for margins untuk menaksif parameter-parameter model variabel laten berbasis copula.

Deskripsi Lengkap: https://lib.ui.ac.id/detail?id=20180890&lokasi=lokal

---

Abstrak

Tugas akhir ini bertujuan menjelaskan prosedur penaksiran parameterparameter model variabel laten bivariat yang dibangun melalui copula dengan menggunakan metode Inference Functions for Margins (IFM). Copula merupakan suatu fungsi yang menghubungkan fungsi distribusi bivariat dengan fungsi-fungsi distribusi marginalnya. Pada tugas akhir ini diberikan suatu contoh penggunaan copula dalam model variabel laten bivariat. Fungsi distribusi bivariat dari model variabel laten dibentuk dengan menggunakan copula yang berasal dari famili copula Gaussian. Famili tersebut dapat dikonstruksi dengan menggunakan fungsi quantile. Pada model variabel laten yang berbasis copula, diperoleh parameter-parameter marginal yang menjelaskan karakteristik dari tiap variabel laten, serta parameter dependensi yang merupakan koefisien korelasi antarvariabel laten. Simulasi dilakukan untuk memberikan gambaran mengenai prosedur metode IFM dalam menaksir parameter-parameter model variabel laten berbasis copula pada bidang keuangan.