

Penaksiran parameter model multinomial probit berdasarkan konsep utilitas

Misdawita, author

Deskripsi Lengkap: <https://lib.ui.ac.id/detail?id=20290142&lokasi=lokal>

Abstrak

Model pilihan diskrit adalah model yang biasa digunakan untuk memodelkan pilihan. Model pilihan diskrit tersebut dapat diturunkan dari fungsi utilitas. Salah satu model pilihan diskrit yang sering digunakan adalah model multinomial probit. Model multinomial probit mengasumsikan bahwa komponen error pada fungsi utilitas berdistribusi normal standar. Model Multinomial Probit berbentuk integral lipat (J-1) dengan J adalah banyaknya alternatif pilihan, dan parameter-parameter yang akan ditaksir berada pada batas-batas integral model tersebut, oleh karena itu dibutuhkan suatu metode simulasi untuk menghitung nilai dari taksiran tersebut. Parameter pada model multinomial probit ditaksir dengan menggunakan metode maximum simulated likelihood estimation (MSLE) yang berdasarkan pada simulasi GHK.

.....Discrete choice model is a model commonly used to model choice. Discrete choice model can be derived from utility functions. One model commonly used discrete choice model is multinomial probit. Multinomial probit model assumes that the errors component in the utility function of standard normal distribution. Multinomial probit models shaped folding integral (J-1) with J is the number of alternative options and the parameters to be estimated to be at the limits of the integral model, and therefore requires a simulation method to calculate the value of those estimates. Parameters in the multinomial probit model was estimated using the method of simulated maximum likelihood estimation (MSLE) is based on the GHK simulation.