

Kondisi ergodik pada model threshold autoregressive (1) = Ergodic condition on threshold autoregressive (1) model

Anatashya Winda Sutanto, author

Deskripsi Lengkap: <https://lib.ui.ac.id/detail?id=20386765&lokasi=lokal>

Abstrak

ABSTRAK

Suatu proses $\{Z_t, t=0,1,2,\dots\}$ memiliki model TAR(1), yaitu adalah koefisien parameter dan ϵ_t merupakan variabel acak yang iid dengan mean 0. Petrucelli dan Woolford (1984) memberikan kondisi ergodik pada model TAR(1) dan estimasi parameter yang dapat diperoleh melalui metode least square. Simulasi dilakukan dengan membangkitkan ϵ_t dan Z_t secara acak, serta dilakukan pada nilai-nilai parameter tertentu.

ABSTRACT

A process $\{Z_t, t=0,1,2,\dots\}$ has TAR(1) model that is parameter coefficients and ϵ_t are a sequence of iid random variables with mean 0. Petrucell and Woolford (1984) gave an ergodic condition on TAR(1) model and parameter estimation using least square method. Simulation are done using generated ϵ_t and Z_t with some different values of parameter.