

## **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**

#### **<b>ABSTRAK</b>**

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

<hr>

#### **<i><b>ABSTRACT</b>**

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