

Aproksimasi p-value dengan roy maksimum dan berdasarkan distribusi tracy widom pada analisis multivariat = Aproximation p value in multivariate analysis with roy test maximum and tracy widom distribution

Sigit Supriyadi, author

Deskripsi Lengkap: <https://lib.ui.ac.id/detail?id=20434155&lokasi=lokal>

Abstrak

ABSTRAK

Dalam analisis multivariate klasik dalam suatu uji hipotesa sering digunakan analisis nilai eigen dalam penentuan statistik ujinya. Dibawah kondisi H_0 , nilai statistik uji yang diperoleh akan digunakan untuk bentuk distribusi yang berkaitan dengan statistik uji. Daerah kritis penolakan suatu uji hipotesa ditentukan berdasarkan bentuk distribusi yang diperoleh. Nilai eigen yang diperoleh untuk analisi multivariat ini untuk pembentukan statistik ujinya bisa menggunakan fungsi yang melibatkan keseluruhan nilai eigen atau dengan menggunakan nilai yang ekstrem. Untuk nilai eigen yang maksimum statistik uji yang digunakan berdasar Roy test maksimum. Cara lain yang digunakan adalah dengan pendekatan distribusi Tracy-Widom. Disamping daerah kritis yang diperoleh juga dibutuhkan p-value berdasar nilai statistik uji yang sebenarnya.

ABSTRACT

Classical multivariate analysis in test hypothesis H_0 most used eigen analysis in determined their test statistics . Under H_0 test statistics which founded will be used to make distribution concerning with test statistics. Critical area H_0 determined their distributions. Eigenvalue which founded will be used to build test statistics may included entirely or eigen value maximum. Roy maximum test had used maximum eigen value for inference by Tracy-Widom distribution. Besides founded critical area, for also wanted p-value for their test statistics which had found