

Runtun waktu autoregresif tingkat pertama berbasis copula

Deskripsi Lengkap: <https://lib.ui.ac.id/detail?id=20180922&lokasi=lokal>

Abstrak

Pada tugas akhir ini akan dibahas mengenai konsep dependensi pada runtun waktu yaitu dependensi antar peubah acak yang dibedakan berdasarkan waktu. Terdapat beberapa konsep dependensi yang digunakan untuk menjelaskan dependensi antar peubah acak, diantaranya adalah konsep dependensi korelasi linier dan concordance. Konsep dependensi yang paling sering digunakan pada runtun waktu adalah korelasi linier meskipun pada kenyataannya korelasi linier memiliki beberapa keterbatasan. Pada tugas akhir ini akan digunakan konsep dependensi concordance melalui copula yang dapat menutupi keterbatasan dari konsep korelasi linier. Salah satu ukuran concordance adalah Kendall's tau. Terdapat beberapa famili copula dimana besar dependensi dapat diukur melalui Kendall's tau, salah satunya adalah famili copula Archimedean. Pada tugas akhir ini akan dikonstruksi model runtun waktu Autoregresif tingkat pertama melalui copula, khususnya dari famili copula Archimedean dan Gaussian.