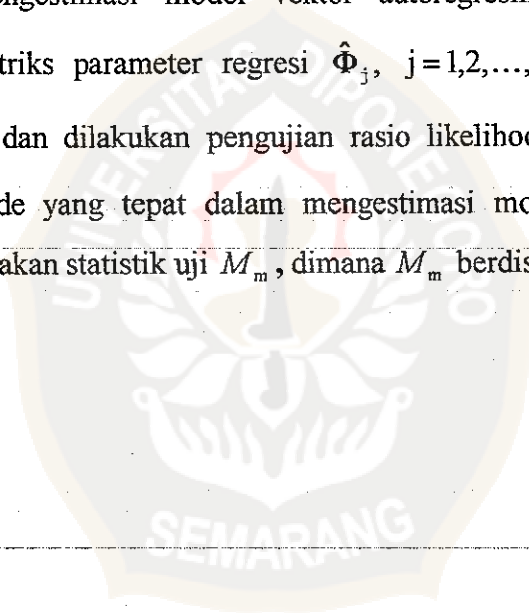


ABSTRAK

Model Vektor Autoregresi adalah model regresi terhadap dirinya sendiri, artinya nilai yang sekarang merupakan kombinasi linier dari nilai-nilai dari masa lalu ditambah vektor white noise. Dalam pembentukan model terlebih dahulu ditentukan vektor rata-rata μ , matriks kovarian $\Gamma(l)$ dan matriks korelasi $\rho(l)$ untuk mengestimasi model vektor autoregresinya. Kemudian untuk memperoleh matriks parameter regresi $\hat{\Phi}_j$, $j=1,2,\dots,m$ digunakan metode kuadrat terkecil dan dilakukan pengujian rasio likelihood terhadap $\hat{\Phi}_j$ untuk mendapatkan orde yang tepat dalam mengestimasi model vektor autoregresi dengan menggunakan statistik uji M_m , dimana M_m berdistribusi χ^2_k .



ABSTRACT

Vector Autoregressive Models is a regression models by itself, it mean the value at time-t on its own past value plus a vector of white noise. In Model building is to obtain sample estimates of mean vector μ , covariance matrices $\Gamma(l)$ and correlation matrices $\rho(l)$ for estimates vector autoregressive models. Thus, to obtain matrix parameter regression $\hat{\Phi}_j$, $j = 1, 2, \dots, m$ by use least square methods and do likelihood ratio testing for $\hat{\Phi}_j$ to obtain order of the vector autoregressive models with statistic M_m , where M_m is distributed as $\chi^2_{k^2}$.

