

ABSTRAK

Distribusi α -stabil dan proses stabil merupakan suatu cabang ilmu probabilitas dalam pemodelan proses stokastik. Distribusi α -stabil ini dapat ditunjukkan dengan fungsi karakteristiknya yang ditentukan oleh indeks kestabilan α dalam interval $(0, 2]$, parameter skala σ , parameter kemiringan β , dan parameter pergeseran μ . Distribusi α -stabil adalah Gaussian bila $\alpha = 2$. Berdasarkan variabelnya, distribusi α -stabil dapat dibedakan menjadi distribusi α -stabil univariat dan distribusi α -stabil multivariat. Fungsi karakteristik distribusi α -stabil multivariat melibatkan ukuran spektral Γ dan vektor pergeseran μ^0 .

Berdasarkan fungsi karakteristiknya distribusi α -stabil juga dapat dibedakan menjadi distribusi α -stabil tegas dan distribusi α -stabil simetris.