

KEMENTERIAN PENDIDIKAN DAN KEBUDAYAAN  
 UNIVERSITAS BRAWIJAYA MALANG  
 FAKULTAS MIPA JURUSAN MATEMATIKA

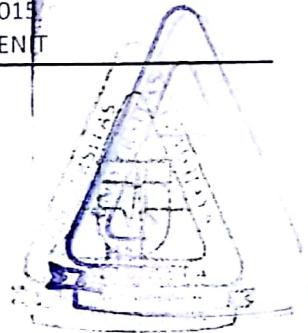
UJIAN AKHIR SEMESTER GENAP 2014/2015

MATA KULIAH/KLS	: M. PERAMALAN/A&B	DOSEN	: HENI KUSDARWATI
SIFAT UJIAN	: BUKA 1 HALAMAN	HARI/TANGGAL	: 24-6-2015
PROGRAM STUDI	: STATISTIKA	WAKTU	: 100 MENIT

- Diketahui fungsi respon dari intervensi

$$\left[ \frac{\varpi_0}{(1-\delta B)} + \frac{\varpi_1}{(1-B)} + \frac{\varpi_2 B}{(1-\delta B)(1-B)} \right] P_i^{(1)}$$

Plot fungsi respon dan diskusikan contoh terapannya



- Tuliskan model outlier jika dari data deret waktu ( $n=100$ ) diketahui terdeteksi 4 outlier

Outlier terdeteksi		
1	7	IO
2	20	AO
3	45	LS
4	60	TC

- Tentukan MACF dari VAR(1)
- Diketahui 3 data deret waktu ( $X_t, Y_t, Z_t$ ). Tulis langkah (metode) pemodelan VARMA , tulis model VARMA(1,1) dan artikan
- Diketahui 3 data deret waktu ( $X_t, Y_t, Z_t$ ). Tulis langkah (metode) pemodelan VECM , tulis model VECM(1,3) dan artikan