



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

1. Diketahui fungsi respon dari intervensi

$$\left[\frac{\omega_0}{(1-\delta B)} + \frac{\omega_1}{(1-B)} + \frac{\omega_2 B}{(1-\delta B)(1-B)} \right] P_i^{(1)}$$

Plot fungsi respon dan diskusikan contoh terapannya

2. 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

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