

# Proses MA(2)

Melalui program R:

- Bangkitkan model MA(2) dengan  $\theta_1 = 0.4$  dan  $\theta_2 = 0.6$  sebanyak 300 data (Manual dan dengan arima.sim)
- Buat plot time series, plot ACF, plot PACF dan plot EACF. Identifikasi apakah data tersebut stasioner
- Buat scatterplot antara  $Y_t$  dengan  $Y_{t-1}$ ,  $Y_t$  dengan  $Y_{t-2}$  serta  $Y_t$  dengan  $Y_{t-3}$
- Hitung autokorelasi masing masing baik dari data bangkitan maupun secara teoritis

# Proses AR(2)

Melalui program R:

- Bangkitkan model AR(2) dengan  $\phi_1 = 0.5$  dan  $\phi_2 = 0.2$  sebanyak 300 data (Manual dan dengan arima.sim)
- Buat plot time series, plot ACF, plot PACF dan plot EACF. Identifikasi apakah data tersebut stasioner
- Buat scatterplot antara  $Y_t$  dengan  $Y_{t-1}$ ,  $Y_t$  dengan  $Y_{t-2}$  serta  $Y_t$  dengan  $Y_{t-3}$
- Hitung autokorelasi masing masing baik dari data bangkitan maupun secara teoritis

# Proses ARMA(2,2)

Melalui program R:

- Bangkitkan model ARMA(2,2) dengan  $\theta_1 = 0.4$ ,  $\theta_2 = 0.6$ ,  $\phi_1 = 0.5$  dan  $\phi_2 = 0.2$  sebanyak 300 data (Manual dan arima.sim)
- Buat plot time series, plot ACF, plot PACF dan plot EACF. Identifikasi apakah data tersebut stasioner
- Buat scatterplot antara  $Y_t$  dengan  $Y_{t-1}$ ,  $Y_t$  dengan  $Y_{t-2}$  serta  $Y_t$  dengan  $Y_{t-3}$
- Hitung autokorelasi masing masing baik dari data bangkitan maupun secara teoritis