

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 $\phi_1 = 0.3$ dan $\phi_2 = 0.7$ 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 AR(2) dengan $\theta_1 = 0.4$, $\theta_2 = 0.6$, $\phi_1 = 0.3$ dan $\phi_2 = 0.7$ 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