

HALAMAN PENGESAHAN I

Lembar : I
Judul skripsi : Fungsi Green Pada Model Autoregressive
Moving Average (n,n-1)
Nama : Wedha
NIM : J 101876711
Tanggal lulus sarjana : - Januari - 1996

Semarang, - Januari - 1996

Jurusan Matematika

Panitia Penguji Ujian Sarjana

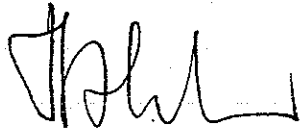
Ketua

Jurusan Matematika

Ketua



Drs. Djuwandi, SU
NIP. 130 810 140

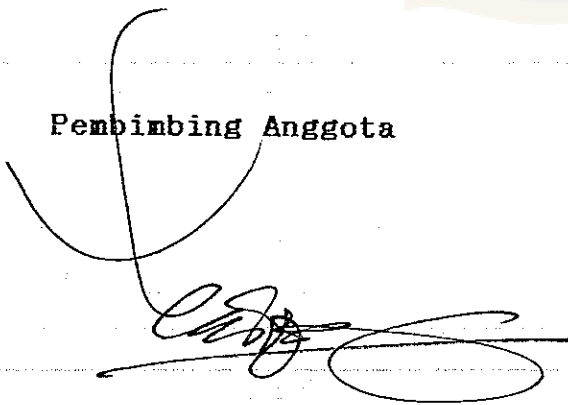

Drs. Mustafid, M Eng PhD
NIP. 130 877 409

HALAMAN PENGESAHAN II

Lembar : II
Judul skripsi : Fungsi Green Pada Model Autoregressive
Moving Average (n,n-1)
Nama : Wedha
NIM : J 101876711
Jurusan : Matematika
Telah diujikan pada ujian sarjana tanggal Januari 1996 dan
dinyatakan lulus.

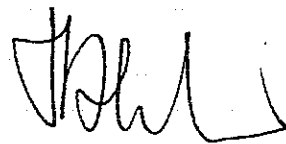
Semarang, - Januari - 1996

Pembimbing Anggota



Drs. Eko Adi Sarwoko
NIP. 131 994 292

Pembimbing Utama



Drs. Mustafid, M Eng PhD
NIP. 130 877 409

HALAMAN PERSEMBAHAN

Skripsi ini kupersembahkan kepada :

- Bapak - ibu tersayang
- Adik - adikku tercinta
- Teman - temanku semua



DAFTAR SIMBOL

X_t	: Nilai pengamatan pada waktu ke t
G_j	: Fungsi Green
ϕ_n	: Parameter Autoregressive pada orde ke n
θ_{n-1}	: Parameter Moving Average pada orde ke $n-1$
a_t	: Shock atau guncangan random pada waktu ke t
λ_n	: Parameter akar-akar karakteristik dari fungsi Autoregressive
NID	: Distribusi Normal Independen
ε_t	: Kesalahan pada waktu ke t
σ_a^2	: Varian a_t
σ_ε^2	: Varian ε_t
Σ	: Jumlahan
Z	: Bilangan Komplek
i	: Unit Imaginer
e	: Bilangan natural
ω	: Sudut yang dibentuk pada koordinat polar

KATA PENGANTAR

Alhamdulillah, segala puja dan puji terpanjatkan kepada Allah yang telah melimpahkan rahmat dan kurnia-Nya sehingga dapat terselesaikannya tugas akhir ini yang merupakan syarat untuk memperoleh gelar sarjana S-1.

Pada kesempatan ini penulis mengucapkan terima kasih kepada Bapak Drs. Mustafid, M Eng PhD selaku Pembimbing Utama dan Bapak Drs. Eko Adi Sarwoko selaku Pembimbing Anggota.

Ucapan terima kasih penulis sampaikan pula kepada :

1. Ibu Dra. Hj. Sriani Hendarko, SU selaku Dekan FMIPA Undip.
2. Bapak Drs. Djuwandi, SU. selaku Ketua Jurusan Matematika UNDIP.
3. Staf Pengajar Jurusan Matematika dan bagian pengajaran FMIPA UNDIP.
4. Rekan-rekan Rejomulyo grup serta semua pihak yang turut membantu yang tak dapat kami sebutkan satu persatu.

Penulis menyadari bahwa masih banyak kekurangan dalam penulisan tugas akhir ini, untuk itu saran dan kritik yang membangun sangat penulis harapkan.

Akhirnya penulis berharap agar skripsi ini dapat bermanfaat bagi pembaca sekalian.

Semarang, Januari 1996

Penulis,

Wedha

NIM. J 101876711

DAFTAR ISI

	Halaman
HALAMAN JUDUL	i
HALAMAN PENGESAHAN I	ii
HALAMAN PENGESAHAN II	iii
HALAMAN PERSEMBAHAN	iv
DAFTAR SIMBOL	v
ABSTRAK	vi
KATA PENGANTAR	vii
DAFTAR ISI	viii
BAB I PENDAHULUAN	1
BAB II MODEL RUNTUN WAKTU ARMA (n,n-1)	5
2.1. Model ARMA (n,n-1)	5
2.2. Model ARMA (1,0) atau AR (1)	6
2.3. Model ARMA (2,1)	7
2.4. Model ARMA (3,2)	10
BAB III FUNGSI GREEN PADA MODEL ARMA (n,n-1)	13
3.1. Fungsi Green Pada ARMA (1,0) Atau AR (1)	14
3.1.1. Interpretasi Secara Fisik	16
3.1.2. Kestabilan Model AR (1)	21
3.2. Fungsi Green Pada Model ARMA (2,1)	22
3.2.1. Pembentukan Fungsi Green Pada Model ARMA (2,1)	22
3.2.2. Kestabilan Model ARMA (2,1)	28
3.3. Aplikasi Fungsi Green	33

BAB IV	KASUS-KASUS KHUSUS PADA PERMASALAHAN	
	FUNGSI GREEN	39
	4.1. Fungsi Green Pada Model AR (2)	39
	4.2. Fungsi Green Pada Model ARMA (1,1)	43
	4.3. Fungsi Green Pada Model ARMA (2,1)	
	Dengan Hasil Akar-akar Karakteristik	
	Yang Berbentuk Akar Kompleks	44
BAB V	KESIMPULAN	50
	DAFTAR PUSTAKA	

