

BAB IV KESIMPULAN

Untuk pemakaian model fungsi transfer sebagai metode peramalan, ada beberapa hal yang perlu diperhatikan :

1. Proses identifikasi, yaitu suatu proses untuk menghasilkan nilai khusus (r, s, b) dan (p_n, q_n) .
2. Setelah model tersebut diidentifikasi, kemudian dilakukan penaksiran untuk parameter-parameter model fungsi transfer.

Parameter yang ditaksir pada model fungsi transfer adalah :

$$\omega_0, \omega_1, \omega_2, \dots, \omega_s, \delta_1, \delta_2, \dots, \delta_r, \theta_1, \theta_2, \dots, \theta_q, \phi_1, \phi_2, \dots, \phi_p.$$

3. Apabila model tersebut telah diidentifikasi, dan seluruh parameter telah ditaksir (diestimasi), maka versi peramalan tersebut dapat ditetapkan.

Untuk $(r, s, b) = (2, 2, 1)$ dan $(p_n, q_n) = (2, 1)$, persamaan diperoleh :

$$\begin{aligned} y_t = & -(\delta_1 + \phi_1)y_{t-1} - (\delta_2 + \phi_2 - \delta_1\phi_1)y_{t-2} + (\delta_1\phi_2 + \delta_2\phi_1)y_{t-3} \\ & + (\delta_2\phi_2)y_{t-4} + (\omega_0x_{t-1} - (\omega_1 + \omega_0\phi_1)x_{t-2} - (\omega_0\phi_2 + \omega_2 - \omega_1\phi_1)x_{t-3} \\ & + (\omega_1\phi_2 + \omega_2\phi_1)x_{t-4} + (\omega_2\phi_2)x_{t-5} - (\delta_1 + \theta_1)a_{t-1} - (-\delta_1\theta_1 + \delta_2)a_{t-2} \\ & + (\theta_1\delta_2)a_{t-3} \end{aligned}$$

Dengan mengetahui nilai parameter dan nilai sebelumnya dari y , x , dan a , maka persamaan ini dapat digunakan untuk menetapkan nilai y untuk periode-periode yang akan datang.

