

ABSTRAK

Pembahasan dalam tulisan ini dibatasi pada proses stokastik stasioner, pada suatu proses stokastik stasioner diberikan sebuah ukuran spektral random $\xi(\Lambda)$ dan sebuah fungsi berharga kompleks $g(\lambda), \lambda \in (-\pi, \pi]$, maka akan dapat disusun sebuah integral stokastik dari $g(\lambda)$ terhadap $\xi(\Lambda)$. Kemudian jika pada integral stokastik di atas, $g(\lambda)$ diganti dengan $g(t, \lambda) = e^{i\lambda t}$ maka akan diperoleh suatu representasi spektral, dimana representasi spektral tersebut dapat diaplikasikan ke dalam solusi-solusi stasioner dari persamaan differensi stokastik.

