

## ABSTRAK

Model runtun waktu multivariat digunakan untuk menganalisa data runtun waktu, dimana model ini terdiri dari beberapa variabel. Sehingga perlu untuk mengetahui sifat-sifat dari model tersebut. Sifat-sifat dari model runtun waktu multivariat antara lain invertibel dan kausal. Model Moving Average multivariat akan invertibel jika determinan dari matriks koefisiennya tidak sama dengan nol dan jumlahan dari akar jumlah kuadrat elemen-elemen matriksnya berhingga. Untuk model Autoregressive multivariat, jika dipenuhi syarat-syarat di atas maka dikatakan model ini kausal.

