

ABSTRAK

MATRIK TRANSFORMASI PADA MODEL LINIER DENGAN GANGGUAN BERKORELASI DALAM PROSES ARMA(p,q)

Dalam penyelesaian model regresi linier diperlukan asumsi bahwa komponen-komponen error dalam model merupakan variabel random yang tidak berkorelasi. Jika asumsi tersebut tidak terpenuhi, maka akan ditentukan sebuah matrik transformasi dengan asumsi error pada model mengikuti proses ARMA (p,q), sehingga dihasilkan model regresi tertransformasi dengan error tidak berkorelasi.

ABSTRACT

MATRIK TRANSFORMASI PADA MODEL LINIER DENGAN GANGGUAN BERKORELASI DALAM PROSES ARMA(p,q)

In linier regression solving needed a assumption that component of disturbances in model are independent random variable. If assumption was not satisfied, so will be found a transformation matrix with assumption that disturbances in model to follow a stationary ARMA(p,q) process, to obtain a transformed regression model with independent disturbances.