BAB IV

KESIMPULAN

Salah satu permasalahan yang sering terjadi dalam regresi linier adalah tidak terpenuhinya asumsi bahwa error dalam model tidak berkorelasi, atau $E(u_t u_j) \neq 0$ untuk $t \neq j$. Dengan asumsi bahwa u_t mengikuti proses ARMA (p,q) dapat ditentukan sebuah matrik transformasi **P** sedemikian sehingga dihasilkan model regresi tertransformasi dengan error yang tidak berkorelasi.

Estimasi parameter pada proses ARMA(p,q) dapat menggunakan fungsi invers, yaitu dengan memasangkan proses AR(n) dimana parameter-parameternya diambil sebagai koefisien fungsi invers. Parameter-parameter proses ARMA(p,q) yang telah diperoleh akan digunakan untuk mencari fungsi autokovarian pada proses tersebut. Setelah fungsi autokovarian diperoleh, maka matrik transformasi **P** dapat ditentukan dengan metode rekursif.