

BAB V

KESIMPULAN DAN SARAN

5.1 Kesimpulan

Berdasarkan hasil pembahasan dan analisis data, dapat diambil beberapa kesimpulan sebagai berikut:

1. Uji Q_{LB} dan Q_{MT} dapat didekati dengan distribusi χ^2_{m-p-q} , sedangkan uji D_m didekati dengan distribusi gamma, $\Gamma(\alpha = b/2, \beta = 1/2\alpha)$ dengan parameternya $\alpha = \frac{3m[(m+1)-2(p+q)]^2}{2[2(m+1)(2m+1)-12m(p+q)]}$ dan $\beta = \frac{3m[(m+1)-2(p+q)]}{2(m+1)(2m+1)-12m(p+q)}$
2. Dalam penerapannya dengan data bangkitan dan data *real*, uji Q_{LB} dan D_m menggunakan autokorelasi residual sedangkan uji Q_{MT} menggunakan autokorelasi parsial residual.
3. Kesensitifan uji ini dapat dilihat dari nilai P_{value} yang kurang dari $\alpha = 0,05$ dari masing-masing uji dengan melakukan pencocokan model yang salah, meskipun pada data *real* ketiga uji ini tidak menunjukkan kesensitifannya sama sekali namun pada data bangkitan uji D_m memiliki nilai P_{value} yang paling kecil diantara uji Q_{LB} dan Q_{MT} , yaitu ketika dilakukan pencocokan dengan model MA(1) dapat dilihat bahwa kesensitifan uji Q_{LB} dan Q_{MT} menurun pada lag yang besar.

5.2 Saran

Beberapa saran yang dapat disampaikan penulis dalam skripsi ini adalah sebagai berikut:

1. Dilakukan pemeriksaan asumsi lebih lanjut pada data *real* yang tidak sensitif terhadap uji D_m , Q_{LB} dan Q_{MT} .
2. Membandingkan uji statistik portmanteau D_m dengan uji Q_{LB} dan Q_{MT} pada data runtun waktu nonstasioner atau pada kasus multivariat seperti model VARIMA.
3. Melakukan perbandingan uji statistik portmanteau D_m dengan uji yang lain seperti uji portmanteau Li-McLeod (Q_{LM}), uji portmanteau McLeod-Li (Q_{ML}) atau uji portmanteau Hong.