

DAFTAR ISI

ABSTRAK	i
KATA PENGANTAR	ii
DAFTAR ISI	iv
DAFTAR TABEL	vii
DAFTAR GAMBAR	viii
DAFTAR LAMPIRAN	ix
DAFTAR SIMBOL	x
BAB I PENDAHULUAN	
1.1 Latar Belakang	1
1.2 Perumusan Masalah	3
1.3 Tujuan Masalah	4
1.4 Batasan Masalah	4
1.5 Sistematika Penulisan	5
BAB II LANDASAN TEORI	
2.1 Analisis Runtun Waktu	7
2.1.1 Proses Stokastik	7
2.1.2 Kestasioneran	8

2.1.3	Rata-Rata, Fungsi Autokovariansi, Fungsi Autokorelasi, dan Fungsi Autokorelasi Parsial	10
2.1.4	<i>White Noise</i>	11
2.1.5	Model Proses Linier Umum	12
2.1.5.1	Model Autoregresif Orde-p (AR(p))	15
2.1.5.1.1	Model Autoregresif Orde-1 (AR(1))	15
2.1.5.1.2	Model Autoregresif Orde-2 (AR(2))	17
2.1.5.2	Model <i>Moving Average</i> Orde-q (MA(q)).....	23
2.1.5.3	Model <i>Autoregressive Moving Average</i> (ARMA(p,q))....	24
2.1.5.4	Model <i>Integrated Autoregressive Moving Average</i> (ARIMA(p,d,q)).....	24
2.1.6	Identifikasi Model	25
2.1.7	Penaksiran Parameter Model Autoregresif	27
2.1.8	Verifikasi (<i>Diagnostic Check</i>).....	31
2.2	Metode Bootstrap Persentil.....	32
 BAB III SELANG KEPERCAYAAN UNTUK PERAMALAN MODEL AUTOREGRESIF		
3.1	Metode Analisis Runtun Waktu Box-Jenkins dalam Menentukan Selang Kepercayaan untuk Peramalan Model Autoregresif	36
3.2	Metode Bootstrap Persentil dalam Menentukan Selang Kepercayaan untuk Peramalan Model Autoregresif	42

BAB IV STUDI KASUS

4.1 Sumber Data 48

4.2 Metode Analisis Runtun Waktu Box –Jenkins dalam Menentukan Selang Kepercayaan untuk Peramalan Model Autoregresif 54

4.3 Metode Bootstrap Persentil dalam Menentukan Selang Kepercayaan untuk Peramalan Model Autoregresif..... 55

BAB IV KESIMPULAN DAN SARAN

4.1 Kesimpulan 59

4.2 Saran 60

DAFTAR PUSTAKA 61

LAMPIRAN-LAMPIRAN 62

