

DAFTAR ISI

HALAMAN JUDUL	i
HALAMAN PENGESAHAN	ii
HALAMAN PERNYATAAN	iii
HALAMAN PERSEMBAHAN	iv
KATA PENGANTAR	v
DAFTAR ISI	vi
DAFTAR GAMBAR	viii
DAFTAR TABEL	ix
DAFTAR LAMPIRAN	x
INTISARI	xi
ABSTRACT	1
BAB 1 PENDAHULUAN	2
1.1 Latar Belakang	2
1.2 Batasan Masalah	3
1.3 Tujuan dan Manfaat Penelitian	4
1.4 Tinjauan Pustaka	4
1.5 Metodologi Penelitian	5
1.6 Sistematika Penulisan	5
BAB 2 LANDASAN TEORI	7
2.1 Matriks	7
2.2 Variabel Random	11
2.3 Distribusi	14
2.3.1 Distribusi Uniform	14
2.3.2 Distribusi Normal	15
2.3.3 Distribusi <i>Heavy-tailed</i>	15
2.4 Analisis Runtun Waktu	17

2.5	Proses Stokastik	18
2.6	Stasioneritas	19
2.7	Fungsi Autokovariansi, Autokorelasi, dan Autokorelasi Parsial	20
2.8	Proses <i>White Noise</i>	22
2.9	Proses Autoregresif	23
2.10	Kausalitas	24
2.11	Estimasi <i>Least Square</i>	25
2.12	Program Linier	28
2.13	Pengukuran Error	30
 BAB 3 ESTIMATOR PROGRAM LINIER UNTUK MODEL AUTO-REGRESIF		32
3.1	Least Square untuk Autoregresif	32
3.2	Estimator Program Linier	33
3.3	Fungsi Objektif Estimator Program Linier	35
3.3.1	Nilai mutlak	35
3.3.2	<i>Minimax fit</i>	36
3.3.3	Meminimumkan persentase error	37
3.4	Metode Penyelesaian Program Linier	37
3.4.1	Metode grafik	38
3.4.2	Metode simpleks	40
 BAB 4 STUDI KASUS		43
4.1	Data	43
4.2	Uji Stasioneritas	44
4.3	Hasil Simulasi	45
4.3.1	AR(1) dengan konstanta	45
4.3.2	AR(1) tanpa konstanta	46
4.3.3	AR(3) dengan konstanta	46
4.3.4	AR(3) tanpa konstanta	47
4.4	Pembahasan	47
 BAB 5 PENUTUP		53
5.1	Kesimpulan	53
5.2	Saran	53
 DAFTAR PUSTAKA		54
 LAMPIRAN		56