

DAFTAR ISI

HALAMAN JUDUL	i
HALAMAN PENGESAHAN	ii
HALAMAN PERNYATAAN	iii
PRAKATA	iv
DAFTAR ISI	vi
DAFTAR TABEL	viii
DAFTAR GAMBAR	ix
INTISARI	x
ABSTRACT	xi
I PENDAHULUAN	1
1.1. Latar Belakang	1
1.2. Pembatasan Masalah	4
1.3. Tujuan dan Manfaat Penelitian	4
1.4. Tinjauan Pustaka	4
1.5. Metode Penelitian	5
1.6. Sistematika Penulisan	5
II LANDASAN TEORI	7
2.1. Peramalan	7
2.2. Konsep Data Runtun Waktu	9
2.2.1. Pola Data Runtun Waktu	10
2.2.2. Stasioneritas	11
2.2.3. Fungsi Autokorelasi	13
2.2.4. Fungsi Autokorelasi Parsial	17
2.3. Model Runtun Waktu Linier dan Nonlinier	20
2.3.1. Model Runtun Waktu Linier	21
2.3.2. Model Runtun Waktu Nonlinier	22
2.4. Uji Linieritas	24
2.5. Model <i>Threshold Autoregressive</i> (TAR)	25
2.6. Mean, Median, dan Kuantil	27
2.7. Regresi Kuantil	33
2.7.1. Regresi Kuantil menggunakan <i>Asymmetric Laplace Distribution</i> (ALD)	35
2.8. Kriteria Pemilihan Model	37
2.9. Estimasi Maksimum <i>Likelihood</i>	38
2.10. Estimator Bayes	39
2.10.1. Distribusi Prior dan Posterior	40
2.10.2. Algoritma Estimator Bayes	41
2.11. Ketepatan Peramalan	42
III MODEL RUNTUN WAKTU QSETAR	44
3.1. <i>Self-Exciting Threshold Autoregressive</i>	44
3.2. <i>Quantile Autoregression</i>	48



3.3. Model <i>Quantile Self-Exciting Threshold Autoregressive</i>	50
3.4. Estimasi Parameter Model <i>Quantile Self-Exciting Threshold Autoregressive</i>	53
IV STUDI KASUS	59
4.1. Data	59
4.2. Uji Stasioneritas Data	60
4.3. Uji Linieritas Data	61
4.4. Identifikasi Model SETAR	62
4.5. Identifikasi QSETAR	66
4.6. Cek Model dengan Data Testing dan Data Training	74
4.7. Peramalan	76
V KESIMPULAN	79
Daftar Pustaka	81
Lampiran	83



DAFTAR TABEL

Tabel 4.1. Estimasi Parameter SETAR	61
Tabel 4.2. Hasil Peramalan Data Testing 5 Periode dan Data Asli	70
Tabel 4.3. Data Hasil Peramalan 5 Periode Kedepan	72



DAFTAR GAMBAR

Gambar 2.1. Jenis-Jenis Pola Data	10
Gambar 2.2. Contoh Data Stasioner	13
Gambar 4.1. Plot Data GDP Sektor Pertanian Indonesia	55
Gambar 4.2. Plot Data GDP Pertanian Indonesia yang telah ditransformasi dan <i>didifferencing</i>	56
Gambar 4.3. Plot fit data GDP Pertanian Indonesia terhadap SETAR(2,8,10,7)	60
Gambar 4.4. Plot fit data GDP Pertanian Indonesia terhadap model QSETAR	69
Gambar 4.5. Plot Data Testing dan Data GDP Pertanian Indonesia	71
Gambar 4.6. Plot Hasil Peramalan	73