

DAFTAR ISI

	Hal.
JUDUL, NAMA, TAHUN	i
DERAJAT	ii
PERSETUJUAN	iii
PERNYATAAN PROMOVENDUS	iv
PERSEMBAHAN	v
PRAKATA	vi
DAFTAR ISI	viii
DAFTAR TABEL	x
DAFTAR GAMBAR	xi
DAFTAR LAMPIRAN	xii
ARTI LAMBANG DAN SINGKATAN	xiii
INTISARI	xvi
ABSTRACT	xvii
 BAB I	
PENDAHULUAN	1
1.1 Latar Belakang Masalah	1
1.2 Perumusan Masalah	8
1.3 Batasan Penelitian	9
1.4 Tujuan Penelitian	10
1.5 Kontribusi Hasil Penelitian	10
1.6 Tinjauan Pustaka	11
1.7. <i>Outline</i> Disertasi.....	14
 BAB II	
ANALISIS RUNTUN WAKTU <i>LONG MEMORY</i>	15
2.1 Analisis Runtun Waktu	15
2.2 Stasioneritas ARFIMA	20
2.3 Proses <i>Long Memory</i>	33
2.4 Proses ARFIMA.....	37
2.4.1 Perluasan AR dan MA <i>Infinite</i>	47
2.4.2 Densitas Spektral	48
2.4.3 Fungsi Autokovariansi.....	48
2.4.4 <i>Mean Sample</i> ..	49
2.4.5 Autokorelasi Parsial	49
2.5 <i>Fraksional Gaussian Noise</i>	51
 BAB III	
<i>RECURRENT NEURAL NETWORK</i>	53
3.1 <i>Neural Networks</i>	53
3.2 <i>Feedforward Neural Networks</i>	56
3.3 <i>Recurrent Neural Network</i>	68

BAB IV	ESTIMASI MODEL ARFIMA.....	75
	4.1 Metode <i>Estimasi Parameter Geweke dan Porter</i>	75
	<i>Hudak (GPH)</i>	
	4.2 Uji Diagnostik pada Model ARFIMA... ..	79
	4.3 Peramalan Model ARFIMA	82
	4.4 Pemilihan Model Terbaik	84
BAB V	HASIL DAN PEMBAHASAN.....	86
	5.1 Algoritma Peramalan Runtun Waktu Berpola <i>Long</i>	86
	<i>Memory</i>	
	5.2 Peramalan Model FIFNN dan Model FIRNN	97
BAB VI	KESIMPULAN DAN PERMASALAHAN TERBUKA	110
	6.1 Kesimpulan	110
	6.2 Permasalahan Terbuka	111
	DAFTAR PUSTAKA	113
	LAMPIRAN-LAMPIRAN.....	117