

Metode peramalan dengan pendekatan model runtun waktu box-jenkins.

Achdalena, author

Deskripsi Lengkap: <https://lib.ui.ac.id/detail?id=20180438&lokasi=lokal>

Abstrak

Tulisan ini membahas metode peramalan dengan pendekatan model runtun waktu Box-Jenkins yang merupakan proses pengembangan dari kombinasi proses Autofegresive (AR) dan proses Moving Average (MA) untuk runtun waktu tidak stasioner menjadi proses Autoregresive Integrated Moving Average (ARIMA). Pembahasan dimulai dengan unsur-unsur yang merupakan konsep analisa runtun waktu Box-Jenkins yaitu : Analisa runtun waktu stasioner dan tidak stasioner, Fungsi Autokovariansi, Fungsi Autokorelasi, Fungsi Autokorelasi parsial, Operator Back—Shift, dan Operator Diferensi. Dilanjutkan dengan menerangkan langkah-langkah penentuan model peramalan dengan metode runtun waktu Box-Jenkins yaitu : Identifikasi model, Estimasi parameter, dan Verifikasi.