

DAFTAR ISI

| | |
|--|------|
| LEMBAR PERSETUJUAN..... | i |
| LEMBAR PENGESAHAN | ii |
| PERNYATAAN KEASLIAN SKRIPSI..... | iii |
| PERNYATAAN PERSETUJUAN PUBLIKASI SKRIPSI | iv |
| ABSTRAK..... | v |
| <i>ABSTRACT</i> | vi |
| KATA PENGANTAR..... | vii |
| DAFTAR ISI..... | ix |
| DAFTAR GAMBAR | xii |
| DAFTAR TABEL..... | xiii |
| DAFTAR SIMBOL..... | xiv |
| DAFTAR LAMPIRAN | xv |
| BAB I PENDAHULUAN..... | 1 |
| 1.1 Latar Belakang | 1 |
| 1.2 Rumusan Masalah | 4 |
| 1.3 Batasan Masalah..... | 4 |
| 1.4 Tujuan Penelitian..... | 5 |
| 1.5 Metode Penelitian..... | 5 |
| 1.6 Sistematika Penulisan..... | 5 |
| BAB II LANDASAN TEORI | 7 |
| 2.1 Statistika | 7 |
| 2.2 Peramalan | 8 |
| 2.2.1 Analisis Deret Waktu | 9 |

| | | |
|---|---|----|
| 2.2.2 | Model Deret Waktu | 11 |
| 2.3 | Stasioneritas..... | 14 |
| 2.3.1 | Transformasi dan <i>Differencing</i> | 14 |
| 2.3.2 | Uji Stasioneritas Data..... | 16 |
| 2.4 | Perubahan Struktur pada deret waktu..... | 17 |
| 2.5 | Proses Stokastik..... | 19 |
| 2.5.1 | Rantai Markov..... | 19 |
| 2.6 | Ekspor..... | 20 |
| BAB III PERBANDINGAN METODE PERAMALAN <i>TIME SERIES MS-AR, MS-REGRESSION</i> DAN <i>MS-VAR</i> | | 21 |
| 3.1 | Markov Switching | 21 |
| 3.2 | Markov Switching Autoregressive (MS-AR)..... | 22 |
| 3.2.1 | Langkah-langkah metode <i>MS-AR</i> | 23 |
| 3.3 | Markov Switching Regression | 24 |
| 3.3.1 | Langkah-langkah Metode <i>MS-REGRESSION</i> | 24 |
| 3.4 | Markov Switching Vector Autoregressive..... | 25 |
| 3.4.1 | Langkah-langkah Metode <i>MS-VAR</i> | 26 |
| 3.5 | Langkah-langkah Analisis | 27 |
| 3.5.1 | Uji Perubahan Struktur..... | 27 |
| 3.5.2 | Uji Kausalitas | 29 |
| 3.5.3 | Uji Diagnostik | 29 |
| 3.6 | Akurasi Peramalan | 30 |
| 3.7 | Tahapan Perbandingan Metode Peramalan <i>Time Series MS-AR, MS-REGRESSION</i> dan <i>MS-VAR</i> | 32 |
| BAB IV STUDI KASUS DAN ANALISA | | 33 |
| 4.1 | Deskripsi Data | 33 |

| | | |
|---------------------|--|----|
| 4.2 | Identifikasi Data | 34 |
| 4.2.1 | Plot <i>Time Series</i> Studi Kasus | 34 |
| 4.2.2 | Stasioneritas | 35 |
| 4.3 | Identifikasi Model | 35 |
| 4.3.1 | Uji Perubahan Struktur..... | 36 |
| 4.3.2 | Identifikasi <i>Breaks</i> pada Perubahan Struktur | 37 |
| 4.3.3 | Pemodelan Markov Switching Autoregressive | 38 |
| 4.3.4 | Pemodelan Markov Switching Regression | 39 |
| 4.3.5 | Pemodelan Markov Switching Vector Autoregressive..... | 40 |
| 4.4 | Uji Diagnostik | 41 |
| 4.5 | Ukuran Ketepatan Model | 41 |
| 4.6 | Peramalan | 42 |
| BAB V PENUTUP..... | | 44 |
| 1.1 | Kesimpulan..... | 44 |
| 1.2 | Saran..... | 45 |
| DAFTAR PUSTAKA..... | | 46 |
| LAMPIRAN..... | | 49 |

