

Model runtun waktu yang dikaitkan dengan gerakan musiman

Winy Lansanny, author

Deskripsi Lengkap: <https://lib.ui.ac.id/detail?id=20180966&lokasi=lokal>

Abstrak

Tugas akhir ini secara umum bertujuan untuk membahas model runtun waktu musiman dan runtun waktu multiplikatif yang merupakan penggabungan runtun waktu non musiman dan runtun waktu musiman, sehingga akan dibahas ciri-ciri dari model runtun waktu, baik runtun waktu non musiman maupun runtun waktu musiman.

Berdasarkan ciri model yang telah dibahas, selanjutnya dilakukan penentuan model yang sesuai untuk data peredaran total uang kertas dan uang logam di Bank Jepang dengan rentang waktu April 1998 - Januari 2007. Pembentukan model dilakukan dengan tiga tahap, yaitu identifikasi model, penaksiran parameter dan diagnosa model. Penaksiran parameter menggunakan metode Momen dan Maximum Likelihood-Unconditional Least Square.