Universitas Indonesia Library >> UI - Skripsi Open

Pendeteksian outlier pada model autoregressive

Melati Ayuwangi, author

Deskripsi Lengkap: https://lib.ui.ac.id/detail?id=20340175&lokasi=lokal

---

Abstrak

Runtun waktu merupakan barisan data yang diukur pada interval waktu yang periodik. Pada pengambilan data runtun waktu seringkali ditemukan adanya outlier, yang dapat mempengaruhi taksiran parameter autoregressive dan peramalan data. Pada skripsi ini diperkenalkan teknik baru untuk mendeteksi outlier pada model autoregressive dan mengidentifikasi jenis outlier sebagai additive atau innovation. Teknik ini diperkenalkan oleh Allan McQuarrie dan Chih L. Tsay, dan dapat digunakan tanpa diketahuinya model order sebenarnya, waktu terjadinya outlier, dan jenis outlier. Pertama, akan dicari taksiran besaran outlier yang meminimumkan residual sum of square (SSE). Kemudian dari taksiran tersebut akan didapatkan pengurangan terhadap SSE yang nantinya akan digunakan untuk mendapatkan besaran pendeteksian outlier dan juga digunakan untuk mengidentifikasi jenis outlier. Akan dicari pula penaksir yang robust untuk standar deviasi.