

DAFTAR ISI

LEMBAR PERNYATAAN.....	ii
LEMBAR PENGESAHAN	iii
ABSTRAK.....	iv
<i>ABSTRACT</i>	v
LEMBAR PERSEMBAHAN.....	vi
KATA PENGHANTAR	viii
DAFTAR ISI.....	ix
BAB I PENDAHULUAN	1
1.1 Latar Belakang	1
1.2 Rumusan Masalah.....	2
1.3 Batasan Masalah	2
1.4 Tujuan	2
1.5 Metodologi.....	2
1.6 Sistematika Penulisan	3
BAB II TINJAUAN PUSTAKA	4
2.1 Emas.....	4
2.2 Model Regresi.....	5
2.3 Rantai Markov	5
2.3.1 Rantai Markov Multivariat.....	7
2.3.2 Orde Pertama Rantai Markov Multivariat.....	7
2.3.3 Rantai Markov Multivariat Orde Tinggi	8
2.3.4 Rantai Markov Multivariat sebagai Regressor : Estimasi Model	8
2.3.5 Estimasi parameter Rantai Markov Multivariat.....	9
2.4 Model <i>Autoregressive Integrated Moving Average</i> (ARIMA)	11
2.4.1 Model <i>Autoregressive</i> (AR).....	11
2.4.2 <i>Diffrencing</i> (d).....	11
2.4.3 Model <i>Moving Average</i> (MA).....	11
2.5 ARMA dan ARIMA	11
2.6 Menghitung MAPE.....	12
2.6.1 <i>Mean Absolute Percentage Error</i> (MAPE).....	12
BAB III PERANCANGAN SISTEM.....	13
3.1 Analisis Perancangan Sistem	13

3.1.1	Data	15
3.1.2	Estimasi Parameter β dan δ pada model regresi	15
3.1.3	Estimasi Parameter Π_j	15
3.1.4	Menghitung Peluang	15
3.1.5	Prediksi dengan Model.....	15
3.1.6	Validasi	16
3.1.7	Output	16
3.3	Diagram Alur Proses ARIMA.....	16
3.3.1	Data Nilai Tukar Dollar Terhadap Rupiah.....	16
3.3.2	Proses Kestasioneran Data	16
3.3.3	Penentuan Orde atau Nilai (p,d,q) dalam ARIMA.....	17
3.3.4	Estimasi Parameter Model ARIMA	17
3.3.5	Prediksi Harga Nilai Tukar dengan ARIMA	17
3.3.6	Hasil Prediksi (<i>Output</i>)	17
3.3.7	Menghitung Error Atau Mape.....	17
BAB IV PENGUJIAN DAN ANALISIS		18
4.1	Grafik Data Harga Emas dan Nilai Tukar.....	18
4.2	Pengujian Sistem.....	18
4.3	Analisis Hasil dan Pengujian Sistem ARIMA	19
4.3.1	Estimasi Parameter Model ARIMA	26
4.3.2	Uji Kebaikan Model (<i>Goodness Of Fit</i>).....	26
4.4	Rantai Markov Multivariat.....	29
4.5	Metode Regresi Linier berganda.....	31
4.6	Hasil Prediksi dari Penelitian Menggunakan Regresi dan Rantai Markov Multivariat.....	33
BAB V KESIMPULAN DAN SARAN		36
5.1	Kesimpulan	36
5.2	Saran	36
DAFTAR PUSTAKA		37
LAMPIRAN.....		38
1.	Persamaan (1).....	38
2.	Persamaan (2).....	40
3.	Persamaan (3).....	41