



Satuan Acara Pengajaran

MAT40244 - Runtun Waktu (S/A)

Pengajar

Fevi Novkaniza S.Si., M.Si

Minggu 1

Materi 1. Definisi runtun waktu
2. Strategi pembentukan model runtun waktu

Media White board, Power Point Presentation

Referensi 1. Cryer, ch 1
2. Box, ch 1

Aktivitas Tutorial

Minggu 2

Materi 1. menjelaskan fungsi mean, otokovariansi dan otokorelasi
2. menjelaskan konsep kestasioneran kuat, lemah, random walk, white noise

Media White board, Power Point Presentation

Referensi 1. Cryer, ch 2-3
2. Box, ch2

Aktivitas Tutorial, Diskusi

Minggu 3

Materi 1. Perbedaan konsep deterministik dan stokastik trend pada model runtun waktu
2. Metode Regresi untuk penaksiran parameter model

Media White board, power point presentation

Referensi 1.Cryer, ch 3
2.Box, ch2

Aktivitas Tutorial

Minggu 4

Materi 1.menjelaskan proses linier umum
2.menjelaskan proses moving average dan smoothing methods

Media White board, power point presentation

Referensi 1.Cryer, ch 4
2.Box, ch 3

Aktivitas Tutorial

Minggu 5

Materi 1.menjelaskan proses Autoregressive
2.menjelaskan proses ARMA

Media white board, power point presentation

Referensi 1.Cryer, ch 4
2.Box, ch 3

Aktivitas tutorial

Minggu 6

Materi menjelaskan konsep invertibilitas pada model MA

Media white board, power point presentation

Referensi 1.Cryer, ch 4
2.Box, ch 3

Aktivitas tutorial

Minggu 7

Materi 1.menjelaskan kestasioneran melalui differencing
2.menjelaskan model ARIMA dan ciri-cirinya

Media White board, power point presentation

Referensi 1.Cryer, ch 5
2.Box, ch 4

Aktivitas Tutorial

Minggu 8

Materi menjelaskan konsep kestasioneran dengan transformasi

Media white board, power point presentation

Referensi 1.Cryer, ch 5
2.Box, ch 4

Aktivitas Tutorial

Minggu 9

Materi UTS

Media

Referensi

Aktivitas

Minggu 10

Materi menjelaskan sifat fungsi otokorelasi sampel dan fungsi otokorelasi parsial sampel

Media White board, power point presentation

Referensi 1.Cryer, ch 6
2.Box, ch 6

Aktivitas Tutorial

Minggu 11

Materi menentukan model berdasarkan runtun yang disimulasi

Media White board, power point presentation

Referensi 1.Cryer, ch 6
2.Box, ch 6

Aktivitas Tutorial

Minggu 12

Materi Penaksiran parameter model menggunakan metode Momen

Media White board, power point presentation

Referensi 1.Cryer, ch 7
2.Box, ch 7

Aktivitas Tutorial

Minggu 13

Materi Menaksir parameter model menggunakan metode Least Square

Media White board, power point presentation

Referensi 1.Cryer, ch 7
2.Box, ch 7

Aktivitas Tutorial

Minggu 14

Materi Menaksir parameter model menggunakan metode Maksimum Likelihood

Media White board, power point presentation

Referensi 1.Cryer, ch 7
2.Box, ch 7

Aktivitas Tutorial

Minggu 15

Materi Diagnostik model runtun waktu yang dihasilkan dan interpretasinya

Media White board, power point presentation

Referensi 1.Cryer, ch 8
2.Box, ch 8

Aktivitas Tutorial

Minggu 16

Materi UAS

Media

Referensi

Aktivitas
