

## DAFTAR ISI

HALAMAN PENGESAHAN I .....	ii
HALAMAN PENGESAHAN II .....	iii
KATA PENGANTAR .....	iv
ABSTRAK .....	v
ABSTRACT .....	vi
DAFTAR TABEL .....	xi
DAFTAR GAMBAR .....	xiii
DAFTAR LAMPIRAN .....	xiv
BAB I PENDAHULUAN .....	15
1.1    Latar Belakang.....	15
1.2    Rumusan Masalah .....	18
1.3    Batasan Masalah.....	19
1.4    Tujuan Penelitian.....	19
BAB II TINJAUAN PUSTAKA.....	20
2.1    Inflasi.....	20
2.2    Deret Waktu ( <i>Time Series</i> ) .....	22
2.2.1.    Stasioneritas Deret Waktu .....	22
2.2.2. <i>Autocorrelation Function</i> (ACF).....	31
2.2.3. <i>Partial Autocorrelation Function</i> (PACF) .....	32
2.3 <i>Autoregressive Integrated Moving Average</i> (ARIMA).....	33
2.3.1.    Proses <i>Autoregressive</i> (AR) .....	33
2.3.2.    Proses <i>Moving Average</i> (MA) .....	36
2.3.3.    Proses <i>Autoregressive Moving Average</i> (ARMA) .....	38
2.3.4.    Proses <i>Autoregressive Integrated Moving Average</i> (ARIMA) .....	39

2.3.5.	Model Subset <i>Autoregressive Moving Average</i> .....	40
2.3.6.	Model Deret Waktu Musiman .....	40
2.4	Perumusan Model ARIMA.....	41
2.4.1.	Identifikasi Model .....	41
2.4.2.	Estimasi Parameter .....	42
2.4.3.	Pemeriksaan Diagnostik .....	46
2.5	Jaringan Saraf Tiruan .....	49
2.6	Logika <i>Fuzzy</i> .....	50
2.6.1	Himpunan <i>Fuzzy</i> .....	51
2.6.2	Fungsi Keanggotaan <i>Fuzzy</i> .....	51
2.6.3	Sistem Inferensi <i>Fuzzy (Fuzzy Inference System)</i> .....	54
2.7	<i>Adaptive Neuro-FuzzyInference System (ANFIS)</i> .....	57
2.7.1	Arsitektur Jaringan ANFIS.....	57
2.7.2	Algoritma Pembelajaran ANFIS .....	60
2.8	<i>Hybrid ARIMA-ANFIS</i> .....	67
2.9	Pemilihan Model Terbaik .....	68
BAB III METODE PENELITIAN.....		70
3.1	Jenis dan Sumber Data .....	70
3.2	Variabel Penelitian .....	70
3.3	Tahapan Analisis Data.....	70
3.4	Diagram Alir Analisis Data .....	73
BAB IV HASIL DAN PEMBAHASAN .....		77
4.1	Analisis Deskriptif Data .....	77
4.2	Stasioneritas.....	78
4.2.1	Transformasi Box-Cox .....	78
4.2.2	Uji Akar Unit <i>Augmented Dickey Fuller</i> .....	79

4.3	Identifikasi Model ARIMA .....	80
4.4	Estimasi dan Uji Signifikansi Parameter Model ARIMA .....	81
4.5	Uji Asumsi Model .....	83
4.5.1	Uji Normalitas Residual .....	83
4.5.2	Uji Independensi Residual.....	84
4.5.3	Uji Heteroskedastisitas Residual .....	85
4.6	Pemilihan Model ARIMA Terbaik.....	87
4.7	Peramalan Tingkat Inflasi Indonesia Menggunakan Metode ANFIS .....	88
4.8	Permalan Tingkat Inflasi Indonesia Menggunakan Metode <i>Hybrid</i> ARIMA-ANFIS .....	99
4.9	Pemilihan Model Peramalan Terbaik .....	109
4.10	Evaluasi Model .....	112
BAB V PENUTUP.....		114
5.1	Kesimpulan.....	114
5.2	Saran .....	115
DAFTAR PUSTAKA .....		116
LAMPIRAN.....		119
Lampiran 1. Tingkat Inflasi Harga Konsumen Nasional Tahunan (Y-on-Y)..		119
Lampiran 2. <i>Syntax</i> dan Output Statistik Deskriptif Data .....		121
Lampiran 3. <i>Syntax</i> dan Output Pembagian Data <i>Training</i> dan <i>Testing</i> .....		122
Lampiran 4. <i>Syntax</i> dan Output Uji Stasioneritas .....		123
Lampiran 5. <i>Syntax</i> dan Output Plot ACF dan PACF .....		125
Lampiran 6. <i>Syntax</i> dan Output Estimasi dan Uji Signifikansi Parameter Model ARIMA .....		126
Lampiran 7. <i>Syntax</i> dan Output Uji Normalitas Residual Model ARIMA .....		129
Lampiran 8. <i>Syntax</i> dan Output Uji Independensi Residual Model ARIMA..		130

Lampiran 9. <i>Syntax</i> dan Output Uji Heteroskedastisitas Residual ARIMA....	132
Lampiran 10. Perhitungan Nilai RMSE Model ARIMA.....	133
Lampiran 11. <i>Syntax</i> dan Output <i>Fuzzy Clustering Means</i> (FCM) Metode ANFIS Terbaik .....	148
Lampiran 12. <i>Syntax</i> dan Output Peramalan Tingkat Inflasi Indonesia Metode ANFIS.....	152
Lampiran 13. <i>Syntax</i> dan Output <i>Fuzzy Clustering Means</i> (FCM) Metode <i>hybrid</i> ARIMA-ANFIS Terbaik .....	181
Lampiran 14. <i>Syntax</i> dan Output Peramalan Tingkat Inflasi Indonesia Metode <i>Hybrid</i> ARIMA-ANFIS.....	186