

ABSTRAK

Nama :Karnadi
Jurusan :Matematika
Judul :Estimasi Parameter Model Autoregresif Menggunakan Metode Bayesian Deret Berkala

Metode bayesian deret berkala merupakan sebuah metode kuantitatif dengan pendekatan bayesian pada data deret waktu yang membutuhkan informasi awal (prior) untuk mendapatkan distribusi posteriornya. Skripsi ini mengkaji tentang metode bayesian deret berkala pada model autoregresif berupa estimasi parameter model. Langkah- langkah estimasi dibuat dengan asumsi distribusi normal sebagai prior model autoregresif berorde 1.

Kata kunci : Bayesian deret berkala, Model Autoregresif , Distribusi Prior , Estimasi Parameter



ABSTRACT

Name : **Karnadi**
Departement : **Mathematics**
Title : **The Estimation of Parameter Autoregressive Models
Using Bayesian Time Series Method**

Bayesian time series method is a quantitative method with a Bayesian approach to time series data that need information early (prior) to get the posterior distribution. This thesis examines the Bayesian method autoregressive time series models such as the model parameter estimation. Measures estimates are made assuming normal distribution as prior autoregressive model of order 1.

Keywords: Bayesian time series, Autoregresif Model, Distribution Prior, Estimation

