

## ABSTRAK

Model state space merupakan himpunan dari informasi saat ini dan masa lalu dimana hal-hal di masa mendatang dapat disajikan melalui pengetahuan state saat ini dan input masa mendatang. Model state space dibentuk dari model ARMA yang diperoleh dari fungsi matriks korelasi sampel yang minimum dan sebagai model awal dari penyajian state space yang selanjutnya dilakukan pemilihan orde dari kecocokan model AR yang optimal berdasarkan AIC. Estimasi parameter-parameter model state space diperoleh dari analisa korelasi kanonik antara space data dengan space prediktor.

