

## DAFTAR ISI

<b>HALAMAN JUDUL</b> .....	<b>i</b>
<b>LEMBAR PENGESAHAN</b> .....	<b>iii</b>
<b>LEMBAR PERNYATAAN</b> .....	<b>v</b>
<b>ABSTRAK</b> .....	<b>vii</b>
<b>ABSTRACT</b> .....	<b>ix</b>
<b>KATA PENGANTAR</b> .....	<b>xi</b>
<b>DAFTAR ISI</b> .....	<b>xiii</b>
<b>DAFTAR TABEL</b> .....	<b>xv</b>
<b>DAFTAR GAMBAR</b> .....	<b>xvii</b>
<b>DAFTAR LAMPIRAN</b> .....	<b>xix</b>
<b>BAB I PENDAHULUAN</b> .....	<b>1</b>
1.1 Latar Belakang Masalah .....	1
1.2 Rumusan Masalah .....	2
1.3 Tujuan Penelitian .....	3
1.4 Manfaat Penelitian .....	3
1.5 Batasan Masalah .....	3
<b>BAB II TINJAUAN PUSTAKA</b> .....	<b>5</b>
2.1 Analisis Deret Waktu .....	5
2.2 Plot Data Deret Waktu .....	5
2.3 Stasioneritas Data Deret Waktu .....	5
2.3.1 Stasioneritas Ragam .....	5
2.3.2 Stasioneritas Rata-Rata .....	6
2.4 Model <i>Vector Autoregressive</i> (VAR) .....	8
2.5 Model <i>Vector Autoregressive with Exogenous Variable</i> (VARX) .....	9
2.6 <i>Matrix Autocorrelation Function</i> (MACF).....	11
2.7 <i>Matrix Partial Autocorrelation Function</i> (MPACF) .....	11
2.8 Pengujian Kausalitas <i>Granger</i> .....	13
2.9 <i>Cross Correlation Function</i> (CCF) .....	15
2.10 Identifikasi Fungsi Respon <i>Impuls</i> .....	16
2.11 <i>Full Information Maximum Likelihood</i> (FIML) .....	21
2.12 Pengujian Signifikansi Parameter .....	24
2.13 Diagnostik Sisaan Model .....	25
2.14 Tinjauan Non Statistika .....	27
2.14.1 Nilai Tukar .....	27

2.14.2	Suku Bunga .....	27
2.14.3	Indeks DJIA .....	28
<b>BAB III</b>	<b>METODE PENELITIAN.....</b>	<b>29</b>
3.1	Sumber Data.....	29
3.2	Langkah-Langkah Pemodelan VARX ( $p,s$ ) .....	29
3.3	Diagram Alir .....	31
<b>BAB IV</b>	<b>HASIL DAN PEMBAHASAN.....</b>	<b>35</b>
4.1	Plot Data Deret Waktu .....	35
4.1.1	Plot Data Nilai Tukar Rupiah .....	35
4.1.2	Plot Data Suku Bunga .....	36
4.1.3	Plot Data Indeks DJIA .....	37
4.2	Stasioneritas terhadap Ragam dan Rata - Rata.....	38
4.2.1	Stasioneritas terhadap Ragam .....	38
4.2.2	Stasioneritas terhadap Rata – Rata .....	40
4.3	Pengujian Kausalitas Antar Variabel .....	42
4.3.1	Uji Kausalitas <i>Granger</i> .....	42
4.3.2	<i>Cross Correlation Function</i> (CCF).....	43
4.4	Identifikasi Model VARX ( $p,s$ ) .....	45
4.5	Pendugaan dan Pengujian Signifikansi Parameter Model VARX ( $p,s$ ) .....	48
4.6	Diagnostik Sisaan Model .....	51
4.6.1	Pengujian Asumsi <i>White Noise</i> .....	51
4.6.2	Pengujian Normalitas Sisaan .....	52
<b>BAB V</b>	<b>PENUTUP .....</b>	<b>55</b>
5.1	Kesimpulan.....	55
5.2	Saran.....	56
<b>DAFTAR PUSTAKA</b>	<b>.....</b>	<b>57</b>
<b>LAMPIRAN</b>	<b>.....</b>	<b>59</b>