

## DAFTAR LAMPIRAN

Lampiran 1	Data Nilai Tukar Rupiah, Suku Bunga, dan Indeks DJIA .....	59
Lampiran 2	Data Hasil Transformasi <i>Box-Cox</i> dan Differensi ...	60
Lampiran 3	Pemeriksaan Stasioneritas Ragam Variabel Nilai Tukar .....	61
Lampiran 4	Pemeriksaan Stasioneritas Ragam Variabel Suku Bunga.....	62
Lampiran 5	Pemeriksaan Stasioneritas Ragam Variabel DJIA .....	63
Lampiran 6	Pengujian Stasioneritas Rata - Rata untuk Variabel Nilai Tukar Rupiah.....	64
Lampiran 7	Pengujian Stasioneritas Rata - Rata untuk Variabel Suku Bunga .....	64
Lampiran 8	Pengujian Stasioneritas Rata - Rata untuk Variabel DJIA .....	65
Lampiran 9	Skema MACF dan MPACF .....	65
Lampiran 10	Pengujian Kausalitas <i>Granger</i> .....	66
Lampiran 11	Nilai Korelasi Silang Variabel Nilai Tukar Rupiah .	67
Lampiran 12	Nilai Bobot Respon <i>Impuls</i> Variabel Nilai Tukar Rupiah .....	68
Lampiran 13	Nilai Korelasi Silang Variabel Suku Bunga.....	69
Lampiran 14	Nilai Bobot Respon <i>Impuls</i> Variabel Suku Bunga...	70
Lampiran 15	Manualisasi Perhitungan CCF .....	71
Lampiran 16	Manualisasi Perhitungan MPACF .....	78
Lampiran 17	Manualisasi Pendugaan Parameter Model VARIX (3,1)(8,0) .....	82
Lampiran 18	Pendugaan Parameter Model VARIX (3,1)(8,0) .....	80
Lampiran 19	Pengujian Asumsi <i>White Noise</i> Sisaan Model VARIX (3,1)(8,0) .....	88
Lampiran 20	Plot Normalitas Sisaan untuk Variabel Nilai Tukar Rupiah .....	89
Lampiran 21	Histogram Sisaan untuk Variabel Nilai Tukar Rupiah .....	90
Lampiran 22	Nilai <i>Skewness</i> dan Kurtosis Sisaan untuk Variabel Nilai Tukar Rupiah .....	90

Lampiran 23	Plot Normalitas Sisaan untuk Variabel Suku Bunga .....	91
Lampiran 24	Histogram Sisaan untuk Variabel Suku Bunga .....	92
Lampiran 25	Nilai <i>Skewness</i> dan Kurtosis Sisaan untuk Variabel Suku Bunga .....	92
Lampiran 26	Nilai Sisaan Model VARIX (3,1)(8,0) dan Jarak Mahalanobis .....	93
Lampiran 27	Pengujian Asumsi Normalitas Multivariat Model VARIX (3,1)(8,0) .....	94
Lampiran 28	Scatter Plot Sisaan Model VARIX (3,1)(8,0) .....	94