

DAFTAR ISI

HALAMAN PENGESAHAN I	ii
HALAMAN PENGESAHAN.....	iii
KATA PENGANTAR	iv
ABSTRAK	v
ABSTRACT	vi
DAFTAR ISI.....	vii
DAFTAR TABEL.....	x
DAFTAR GAMBAR	xi
DAFTAR LAMPIRAN.....	xii
BAB I PENDAHULUAN	1
1.1 Latar Belakang	1
1.2 Rumusan Masalah.....	4
1.3 Batasan Masalah	4
1.4 Tujuan Penelitian	4
BAB II TINJAUAN PUSTAKA.....	5
2.1 Nilai Tukar Mata Uang	5
2.2 Analisis Runtun Waktu	8
2.3 Stasioneritas Data.....	10
2.3.1. Stasioneritas dalam Varian.....	10
2.3.2. Stasioneritas dalam Mean	16
2.4 Fungsi Autokorelasi dan Autokorelasi Parsial.....	18
2.4.1 Fungsi Autokorelasi (ACF).....	18
2.4.2 Fungsi Autokorelasi Parsial (PACF).....	18
2.5 Model Time Series Stasioner	19
2.5.1 Model <i>Autoregressive</i> (AR).....	19
2.5.2 Model <i>Moving Average</i> (MA)	20
2.5.3 Model <i>Autoregressive Moving Average</i> (ARMA).....	21
2.6 Model Time Series Tidak Stasioner.....	22
2.6.1 Model <i>Autoregressive Integrated Moving Average</i> (ARIMA).....	22
2.6.2 Model <i>Autoregressive Integrated Moving Average</i> (ARIMA) Subset .	23

2.6.3 Model <i>Autoregressive Fractionally Integrated Moving Average</i> (ARFIMA)	24
2.7 Tahapan Pemodelan ARFIMA	25
2.7.1 Identifikasi Sifat <i>Long Memory</i>	25
2.7.2 Estimasi Parameter <i>Differencing</i>	27
2.7.3 Estimasi Parameter Model ARFIMA	28
2.8 Uji Signifikansi Parameter Model	33
2.9 Uji Diagnostik Model	34
2.9.1 Uji Normalitas Residual.....	34
2.9.2 Uji Independensi Residual	35
2.9.3 Uji Homoskedastisitas Residual	36
2.10 Pemilihan Model Terbaik	37
2.11 Evaluasi Model	37
2.12 GUI R.....	38
BAB III METODE PENELITIAN.....	39
3.1 Jenis dan Sumber Data.....	39
3.2 Variabel Penelitian.....	39
3.3 Tahapan Analisis Data	39
3.4 Diagram Alir Analisis Data	41
BAB IV HASIL DAN PEMBAHASAN	43
4.1 Deskripsi Data.....	43
4.2 Stasioneritas	44
4.2.1 Stasioneritas dalam Varian	44
4.2.2 Stasioneritas dalam Mean	45
4.3 Identifikasi <i>Long Memory</i>	47
4.4 Estimasi Parameter Pembeda (d)	48
4.5 Identifikasi Model ARFIMA	49
4.6 Estimasi Parameter Model ARFIMA.....	51
4.7 Uji Signifikansi Parameter Model ARFIMA	53
4.8 Uji Diagnostik Model	55
4.8.1 Uji Normalitas Residual.....	55
4.8.2 Uji Independensi Residual	56

4.8.3 Uji Homoskedastisitas Residual	58
4.9 Model Terbaik.....	60
4.10 Evaluasi Model	62
4.11 Hasil Peramalan	63
4.12 <i>Graphical User Interface (GUI) R</i>	63
BAB V PENUTUP.....	72
5.1. Kesimpulan	72
5.2. Saran	73
DAFTAR PUSTAKA	74
LAMPIRAN.....	77