

DAFTAR ISI

HALAMAN PENGESAHAN I	ii
HALAMAN PENGESAHAN II	iii
KATA PENGANTAR.....	iv
HALAMAN PERSEMBAHAN	vi
ABSTRAK	vii
ABSTRACT.....	viii
DAFTAR ISI	ix
DAFTAR TABEL	xi
DAFTAR GAMBAR.....	xii
DAFTAR LAMPIRAN.....	xiii
BAB I PENDAHULUAN	1
1.1 Latar Belakang.....	1
1.2 Rumusan Masalah.....	7
1.3 Batasan Masalah	7
1.4 Tujuan Penelitian	8
BAB II TINJAUAN PUSTAKA.....	9
2.1 Regresi Nonparametrik	9
2.2 Estimator Densitas Kernel	10
2.3 Regresi Kernel	15
2.4 Analisis <i>Time Series</i>	20
2.5 Model <i>Autoregressive</i>	21
2.6 Stasioneritas Data <i>Time Series</i>	21
2.6.1 Stasioneritas Dalam Varians.....	22
2.6.2 Stasioneritas Dalam Mean	27
2.7 Model Nonparametrik <i>Time Series</i>	30
2.8 Fungsi Autokorelasi (ACF).....	32
2.9 Fungsi Autokorelasi Parsial (PACF)	34
2.10 Pemilihan <i>Bandwidth</i> Optimal dengan <i>Generalized Cross Validation</i> ..	36
2.11 Koefisien Determinasi	41

2.12	<i>Mean Absolute Percentage Error (MAPE)</i>	44
2.13	PT Bank Central Asia.....	45
BAB III METODE PENELITIAN		46
3.1	Jenis dan Sumber Data.....	46
3.2	Variabel Penelitian	46
3.3	Tahapan Analisis Data.....	47
BAB IV HASIL DAN PEMBAHASAN		51
4.1	Deskripsi Data	51
4.2	Uji Stasioneritas.....	54
4.2.1	Uji Stasioneritas Dalam Varians.....	54
4.2.2	Uji Stasioneritas Dalam <i>Mean</i>	55
4.3	Penentuan Variabel Prediktor <i>Lag</i> Menggunakan Plot PACF.....	57
4.4	Visualisasi Variabel Respon dan Variabel Prediktor	58
4.5	Pemodelan Regresi Kernel <i>Time Series</i>	60
4.6	Penentuan Kombinasi <i>Bandwidth</i> Optimal	61
4.7	Ukuran Kelayakan Model	72
4.8	Evaluasi Kinerja Model	69
4.9	Peramalan Harga Saham BBKA Beberapa Periode ke Depan	71
BAB V PENUTUP.....		72
5.1	Kesimpulan.....	76
5.2	Saran.....	77
DAFTAR PUSTAKA		78
LAMPIRAN.....		82