

## 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