

DAFTAR ISI

HALAMAN JUDUL	i
HALAMAN PENGESAHAN I	ii
HALAMAN PENGESAHAN II	iii
KATA PENGANTAR	iv
ABSTRAK	v
ABSTRACT	vi
DAFTAR ISI	vii
DAFTAR TABEL	ix
DAFTAR GAMBAR	x
DAFTAR LAMPIRAN	xi
BAB I PENDAHULUAN	1
1.1 Latar Belakang	1
1.2 Rumusan Masalah	6
1.3 Batasan Masalah.....	6
1.4 Tujuan Penelitian.....	7
BAB II TINJAUAN PUSTAKA	8
2.1 Indeks Harga Saham Gabungan (IHSG)	8
2.2 Indeks <i>Dow Jones Industrial Average</i> (DJIA).....	10
2.3 Jumlah Uang Beredar (JUB)	11
2.4 Regresi Parametrik	12
2.5 Regresi Nonparametrik.....	16
2.6 Regresi Nonparametrik dengan Pendekatan <i>Spline Truncated</i>	17
2.7 Regresi Semiparametrik	21
2.8 Regresi Semiparametrik dengan Pendekatan <i>Spline Truncated</i>	22

2.9	Penentuan Titik Knot Optimal.....	28
2.10	Pembagian Data <i>In Sample</i> dan Data <i>Out Sample</i>	29
2.11	Koefisien Determinasi	30
2.12	<i>Mean Absolute Percentage Error</i> (MAPE)	31
BAB III METODE PENELITIAN		32
3.1	Jenis dan Sumber Data	32
3.2	Variabel Penelitian.....	32
3.3	Tahapan Analisis Data	33
3.4	Diagram Alir Penelitian.....	34
BAB IV HASIL DAN PEMBAHASAN.....		35
4.1	Eksplorasi Data.....	35
4.2	Pemodelan Regresi Semiparametrik <i>Spline Truncated</i>	38
4.2.1	Pemilihan Model Regresi Semiparametrik <i>Spline Truncated</i> Orde 2... 39	
4.2.2	Pemilihan Model Regresi Semiparametrik <i>Spline Truncated</i> Orde 3... 42	
4.2.3	Pemilihan Model Regresi Semiparametrik <i>Spline Truncated</i> Orde 4... 45	
4.3	Pemilihan Model Terbaik	48
4.4	Estimasi Parameter Model Terbaik.....	49
4.5	Ukuran Keباikan Model	52
4.6	Evaluasi Kinerja Model.....	53
BAB V PENUTUP.....		56
5.1	Kesimpulan.....	56
5.2	Saran.....	57
DAFTAR PUSTAKA.....		58
LAMPIRAN.....		62