

DAFTAR ISI

HALAMAN JUDUL.....	i
HALAMAN PENGESAHAN I	ii
HALAMAN PENGESAHAN.....	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	5
1.3 Batasan Masalah.....	6
1.4 Tujuan Penelitian.....	6
BAB II TINJAUAN PUSTAKA.....	7
2.1 Indeks Harga Saham Gabungan (IHSG)	7
2.2 Nilai Tukar (Kurs)	8
2.3 Indeks Pasar Saham Amerika Serikat (S&P 500)	8
2.4 Pengertian Peramalan (<i>Forecasting</i>).....	9
2.5 Kegunaan Peramalan	10
2.6 Metode Peramalan	12
2.7 Pengertian Data <i>Time Series</i>	12
2.8 Jenis Pola Data	13
2.9 Ketepatan Model Peramalan.....	16
2.10 Metode <i>Smoothing</i>	18
2.11 Metode ARIMA <i>Box-Jenkins</i>	19
2.12 Estimasi Parameter ARIMA	24
2.13 Uji Signifikansi Model ARIMA	26

2.14	Uji Stasioneritas Data	26
2.15	Differencing	29
2.16	Uji Kointegrasi.....	29
2.17	Penentuan Panjang Lag.....	33
2.18	Penentuan ordo terbaik	34
2.19	Model Vector Autoregressive (VAR).....	34
2.20	Model Vector Error Correction Model (VECM).....	41
2.21	Uji Independensi Residual	43
2.22	Pengujian Asumsi Distribusi Normal dari Residual	44
BAB III METODE PENELITIAN.....		45
3.1	Jenis dan Sumber Data	45
3.2	Variabel Penelitian	45
3.3	Tahapan Analisis Data.....	45
3.4	Diagram Alir Analisis Data	47
BAB IV HASIL DAN PEMBAHASAN		48
4.1	Analisis Deskriptif Data	48
4.2	Uji Stasioneritas Data	49
4.3	Uji Kointegrasi Model.....	52
4.2.1	Uji Statistik λ_{trace}	52
4.2.2	Uji Statistik λ_{max}	53
4.4	Penentuan Lag Optimal (Maximum).....	54
4.5	Identifikasi Model <i>Vector Error Correction Model</i> (VECM).....	54
4.6	Estimasi Parameter VECM Lag 1	55
4.7	Uji Independensi Residual.....	57
4.8	Uji Independensi Residual.....	58
4.9	Plot Time Series	59
4.10	Mencari Nilai <i>Mean Average Percentage Error</i> (MAPE).....	60
4.11	Peramalan dengan Model VECM	61
BAB V KESIMPULAN.....		62
DAFTAR PUSTAKA		63
LAMPIRAN.....		65