

## DAFTAR ISI

Abstrak .....	i
Kata Pengantar .....	ii
Ucapan Terima Kasih .....	iv
Daftar Isi .....	vi
Daftar Tabel .....	xi
Daftar Gambar .....	xii
<b>BAB I PENDAHULUAN .....</b>	<b>1</b>
1.1 Latar Belakang Masalah.....	1
1.2 Rumusan Masalah .....	3
1.3 Batasan Masalah .....	3
1.4 Tujuan dan Kegunaan Penelitian .....	4
1.5 Sistematika Penulisan.....	5
<b>BAB II LANDASAN TEORI .....</b>	<b>6</b>
2.1 Pendahuluan.....	6
2.2 Tinjauan Ekonomi.....	6
2.2.1 Alasan Penggunaan Mata Uang Asing.....	6
2.2.2 Pengertian Valuta Asing .....	7
2.2.3 Teori Nilai Tukar .....	8
2.2.4 Mekanisme Bursa Valuta Asing.....	9
2.2.4.1 Pendahuluan .....	9
2.2.4.2 Tiga Prinsip Bursa Valas .....	10

2.2.4.3 Fungsi Bursa Valas.....	10
2.2.4.4 Penyebab Perbedaan Kurs Valas .....	10
2.3 Beberapa Ukuran Statistik yang Diperlukan.....	11
2.3.1 Rataan Hitung .....	11
2.3.2 Variansi .....	11
2.4 Dasar-dasar Peramalan Kuantitatif .....	13
2.4.1 Peramalan eksplanatoris dan Deret Berkala .....	13
2.4.2 Taksiran Kuadrat Terkecil .....	16
2.5 Pengukuran Kesalahan Peramalan.....	19
2.6 Metode Perataan ( <i>Average</i> ).....	21
2.6.1 Nilai Tengah ( <i>Mean</i> ) .....	22
2.6.2 Rata-rata Bergerak Tunggal ( <i>Single Moving Average</i> ) .....	24
2.6.3 Rata-rata Bergerak Ganda ( <i>Double Moving Average</i> ) .....	28
2.6.4 Kombinasi Rata-rata Bergerak Lainnya .....	30
2.7 Metode Pemulusan ( <i>Smoothing</i> ) Eksponensial Tunggal .....	33
2.8 Pemulusan Eksponensial Tunggal dengan Pendekatan Adiptif .....	40
2.9 Beberapa Konsep Dasar dalam Analisis Deret Berkala .....	41
2.9.1 Stasioneritas dan Pengujian Stasioneritas Suatu Deret Berkala ..	41
2.9.2 Model Stasioner .....	43
2.9.2.1 Model Autoregressive ( $p,0$ ) .....	44
2.9.2.2 Model Moving Average ( $0,q$ ) .....	45
2.9.2.3 Model <i>Mixed Autoregressive/ Moving Average</i> atau Model Campuran .....	46

2.9.2.4 Fungsi Autokorelasi .....	46
2.9.2.5 Operator <i>Backshift</i> .....	47
2.9.2.6 Menghilangkan Ketidakstasioneran dalam Deret Berkala .....	48
2.9.2.7 Model Umum .....	50
2.9.3 Faktor Musiman ( <i>seasonality</i> ) dalam Suatu Deret Berkala .....	51
<b>BAB III PEMBAHASAN</b> .....	<b>53</b>
3.1 Metode Pemulusan ( <i>smoothing</i> ) Eksponensial Ganda .....	53
3.1.1 Pemulusan ( <i>smoothing</i> ) Eksponensial Ganda dengan Metode Linier Satu Parameter dari Brown .....	53
3.1.2 Pemulusan ( <i>smoothing</i> ) Eksponensial Ganda Dengan Metode Dua Parameter dari Holt.....	56
3.2 Metode Deret Berkala Box-Jenkins .....	59
3.2.1 Tahap-tahap Analisis Deret Berkala Box-Jenkins .....	59
3.2.1.1 Pendahuluan .....	59
3.2.2 Identifikasi .....	60
3.2.3 Taksiran Parameter pada Model ( <i>Fitting</i> ) .....	62
3.2.4 Diagnosis Model .....	64
3.2.5 Peramalan .....	65
<b>BAB IV STUDI KASUS</b> .....	<b>68</b>
4.1 Data Penguji .....	68
4.2 Pola Data .....	70
4.2.1 Autokorelasi .....	70

4.2.2 Autokorelasi Parsial .....	71
4.3 Metode Pemulusan Eksponensial .....	72
4.3.1 Metode Pemulusan Eksponensial dari Brown .....	72
4.3.1.1 Model Peramalan .....	72
4.3.2 Metode Pemulusan Eksponensial dari Holt's .....	74
4.3.2.1 Model Peramalan .....	75
4.3.3 Metode Peramalan Box-Jenkins .....	76
4.3.3.1 Peramalan Nilai Beli Mata Uang US Dollar .....	76
4.3.3.1.1 Fungsi Autokorelasi (fak) .....	76
4.3.3.1.2 Fungsi Autokorelasi Parsial (fakp) .....	77
4.3.3.1.3 Identifikasi Model .....	77
4.3.3.1.4 Estimasi Parameter .....	77
4.3.3.1.5 Diagnosis Model .....	82
4.3.3.1.6 Kesimpulan .....	84
4.3.3.1.7 Peramalan ( <i>forecasting</i> ) .....	85
4.3.4 Perbandingan Metode Peramalan .....	87
4.3.5 Peramalan dengan Metode ARIMA Box-Jenkins .....	88
4.4 Analisa Nilai Mata Uang Tertinggi dan Terendah dalam Seminggu.....	89
4.4.1 Pendahuluan .....	89
4.4.2 Metode peramalan Box-Jenkins untuk Hari Senin .....	90
4.4.2.1 Plot Data untuk Hari Senin .....	90
4.4.2.2 Fungsi Autokorelasi (fak) .....	90

4.4.2.3 Fungsi Autokorelasi Parsial (fakp) .....	91
4.4.2.4 Peramalan .....	92
4.4.3 Metode peramalan Box-Jenkins untuk Hari Selasa .....	93
4.4.3.1 Plot Data untuk Hari Selasa .....	93
4.4.3.2 Fungsi Autokorelasi (fak) .....	93
4.4.3.3 Fungsi Autokorelasi Parsial (fakp) .....	94
4.4.3.4 Peramalan .....	94
4.4.4 Metode peramalan Box-Jenkins untuk Hari Rabu .....	95
4.4.4.1 Plot Data untuk Hari Rabu .....	95
4.4.4.2 Fungsi Autokorelasi (fak) .....	95
4.4.4.3 Fungsi Autokorelasi Parsial (fakp) .....	96
4.4.4.4 Peramalan .....	97
4.4.5 Metode peramalan Box-Jenkins untuk Hari Kamis .....	98
4.4.5.1 Plot Data untuk Hari Kamis .....	98
4.4.5.2 Fungsi Autokorelasi (fak) .....	98
4.4.5.3 Fungsi Autokorelasi Parsial (fakp) .....	99
4.4.5.4 Peramalan .....	99
4.4.6 Metode peramalan Box-Jenkins untuk Hari Jum'at .....	100
4.4.6.1 Plot Data untuk Hari Jum'at .....	100
4.4.6.2 Fungsi Autokorelasi (fak) .....	100
4.4.6.3 Fungsi Autokorelasi Parsial (fakp) .....	101
4.4.6.4 Peramalan .....	102
4.4.7 Nilai Beli US Dollar Tertinggi dan Terendah .....	103

<b>BAB V KESIMPULAN DAN SARAN</b> .....	104
5.1 Kesimpulan .....	104
5.2 Saran .....	105
<b>DAFTAR PUSTAKA</b> .....	106
<b>LAMPIRAN</b> .....	107

