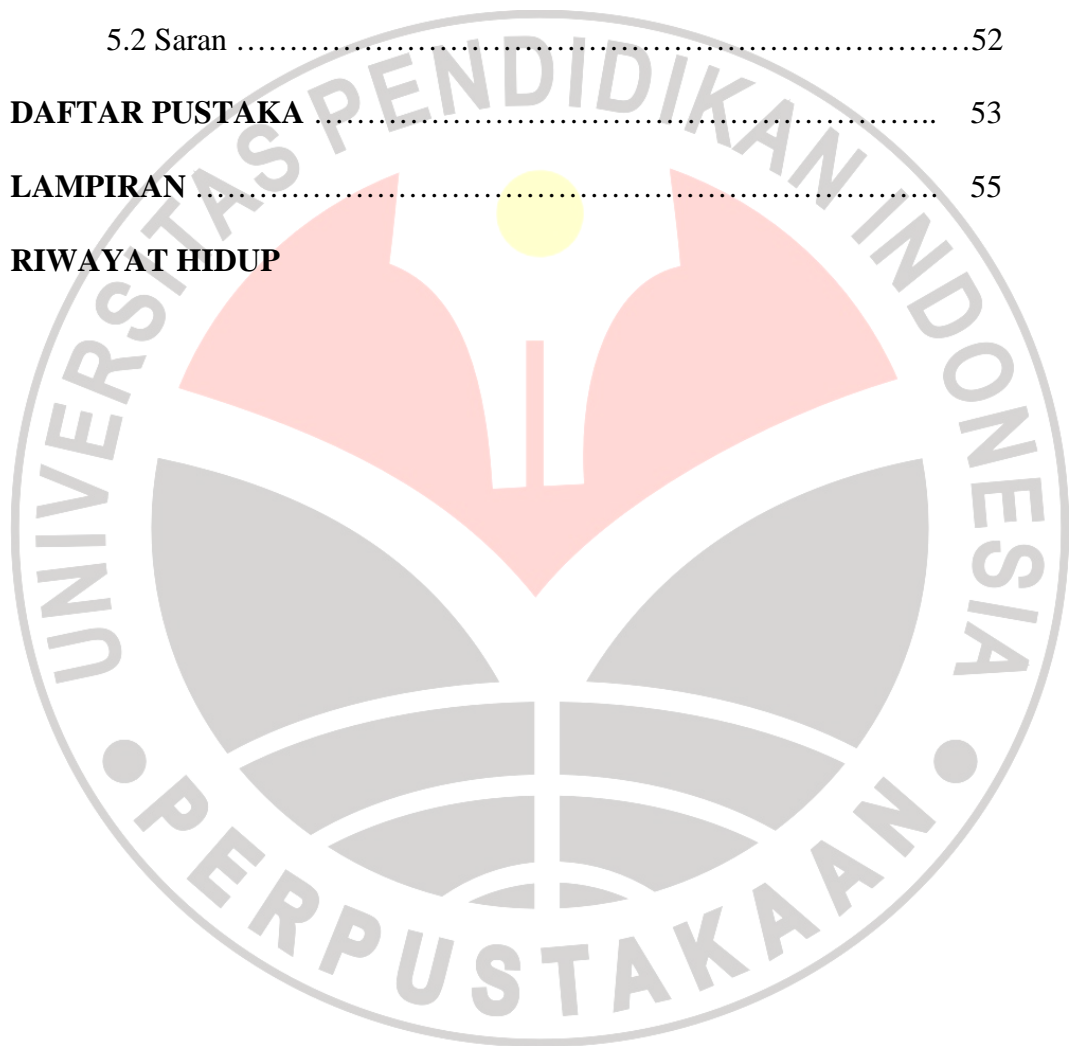


DAFTAR ISI

	Halaman
ABSTRAK	i
KATA PENGANTAR	ii
UCAPAN TERIMA KASIH	iii
DAFTAR ISI	v
DAFTAR TABEL	viii
DAFTAR GAMBAR	ix
DAFTAR LAMPIRAN	x
BAB I PENDAHULUAN	1
1.1	Latar
Belakang Masalah	1
1.2 Batasan Masalah	4
1.3 Rumusan Masalah	4
1.4 Tujuan Penulisan	4
1.5 Manfaat Penulisan	5
BAB II LANDASAN TEORI	6
2.1 Konsep Dasar Runtun Waktu	6
2.1.1 Konsep Stasioneritas	6
2.1.2 Fungsi Autokorelasi (FAK)	9
2.1.3 Fungsi Autokorelasi Parsial (FAKP)	10
2.2 Beberapa Model Dasar Runtun Waktu dari Box Jenkins	11

2.2.1 Model Runtun Waktu Linear untuk Data Stasioner	13
2.2.1.1 Model AR	13
2.2.1.2 Model MA	14
2.2.1.3 Model ARMA	16
2.2.2 Model Runtun Waktu Linear untuk Data Nonstasioner...	17
2.3 Pembentukan Model	18
2.3.1 Identifikasi Model	18
2.3.2 Estimasi Parameter	19
2.3.3 Verifikasi Model	20
2.3.4 Peramalan	21
2.4 Metode <i>Least Square</i> dalam Kasus Nonlinear	23
2.5 <i>Return</i>	27
BAB III SMOOTH TRANSITON AUTOREGRESSIVE	29
3.1. Model <i>Smooth Transition Autoregressive</i>	29
3.2 Uji Nonlinearitas	31
3.3 Estimasi Parameter	35
3.4 Kriteria Pemilihan Model Terbaik	36
3.5 Peramalan	37
BAB IV STUDI KASUS	38
4.1 Deskripsi Data	38
4.2 Identifikasi Model	38
4.2.1 Uji Stasioneritas	38
4.2.2 Pemodelan Autoregressive (AR).....	41

4.2.3 Uji Nonlinearitas	43
4.2.4 Pemodelan <i>Smooth Transition Autorgeressive</i>	44
4.3 Peramalan	47
BAB V KESIMPULAN DAN SARAN	50
5.1 Kesimpulan.....	50
5.2 Saran	52
DAFTAR PUSTAKA	53
LAMPIRAN	55
RIWAYAT HIDUP	

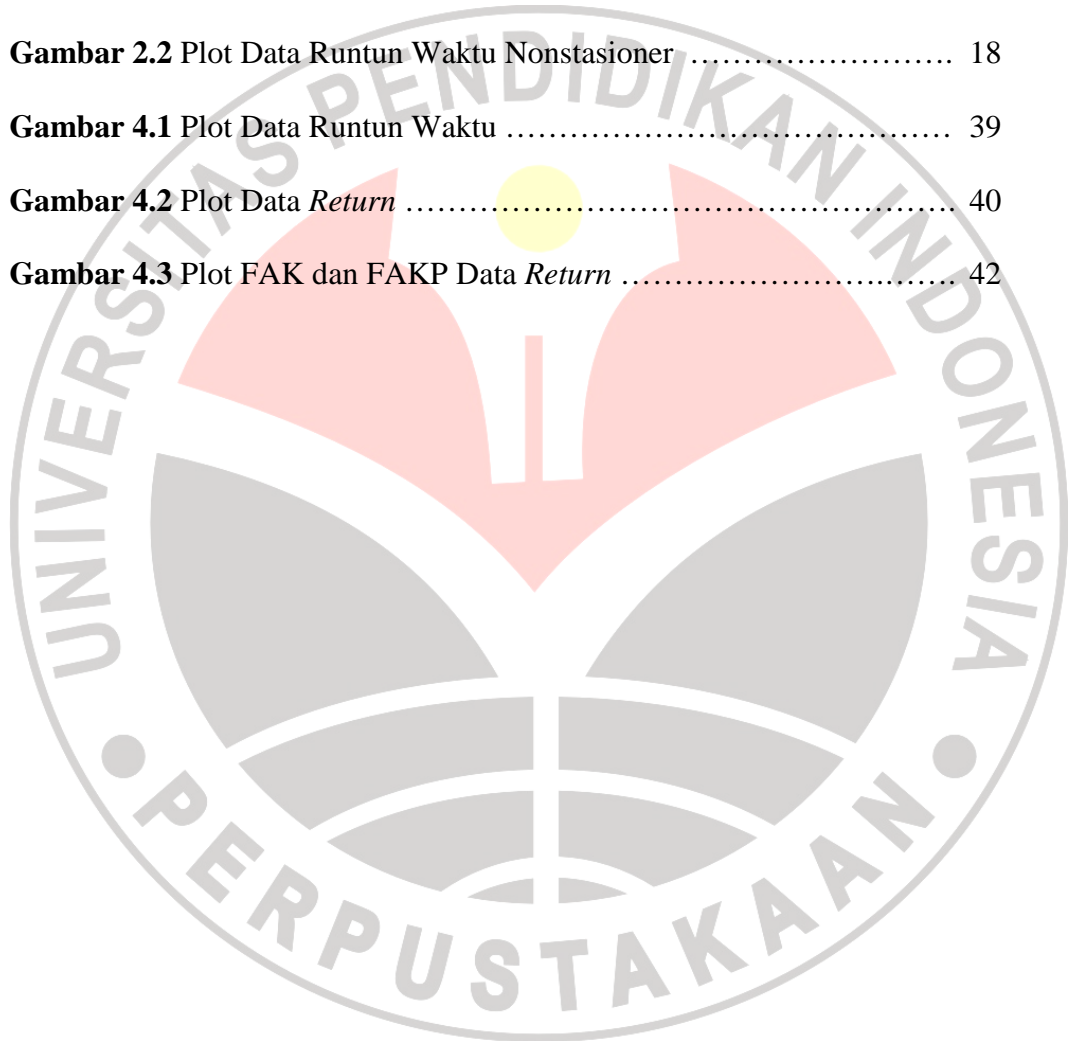


DAFTAR TABEL

	Halaman
Tabel 4.1 Hasil Uji Augmented Dickey-Fuller (ADF)	40
Tabel 4.2 Hasil Uji Augmented Dickey-Fuller (ADF) Data <i>Return</i>	41
Tabel 4.3 Hasil Estimasi Parameter Model AR(2)	43
Tabel 4.4 Hasil Uji Nonlinearitas	44
Tabel 4.5 Hasil Estimasi Parameter Model LSTAR dengan Variabel Transisi y_{t-1}	45
Tabel 4.6 Hasil Estimasi Parameter Model LSTAR dengan Variabel Transisi y_{t-2}	46
Tabel 4.7 Hasil Peramalan Model LSTAR dengan Variabel Transisi y_{t-1}	47
Tabel 4.8 Data Nilai Tukar Rupiah terhadap <i>Bath</i> yang Sebenarnya	48
Tabel 4.9 Hasil Peramalan Model AR(2)	48
Tabel 4.10 Evaluasi Peramalan untuk Model LSTAR dengan Variabel Transisi	49
Tabel 4.11 Evaluasi Peramalan untuk AR(2)	49

DAFTAR GAMBAR

	Halaman
Gambar 2.1 Plot Data Runtun Waktu Stasioner	7
Gambar 2.2 Plot Data Runtun Waktu Nonstasioner	18
Gambar 4.1 Plot Data Runtun Waktu	39
Gambar 4.2 Plot Data <i>Return</i>	40
Gambar 4.3 Plot FAK dan FAKP Data <i>Return</i>	42



DAFTAR LAMPIRAN

	Halaman
Lampiran 1 Nilai Tukar Rupiah terhadap <i>Bath</i>	55
Lampiran 2 Nilai <i>Return</i>	66
Lampiran 3 Hasil Uji ADF Nilai Tukar	76
Lampiran 4 Hasil Uji ADF <i>Return</i>	77
Lampiran 5 Hasil Estimasi Parameter Model ARMA	77
Lampiran 6 Hasil Uji Nonlinearitas.....	89
Lampiran 7 Hasil Estimasi Parameter Model LSTAR dengan Variabel Transisi y_{t-1}	90
Lampiran 8 Hasil Estimasi Parameter Model LSTAR dengan Variabel Transisi y_{t-2}	91