

DAFTAR ISI

	Halaman
ABSTRAK	i
KATA PENGANTAR	ii
UCAPAN TERIMA KASIH	iii
DAFTAR ISI	vi
DAFTAR TABEL	ix
DAFTAR GAMBAR	x
DAFTAR LAMPIRAN	xi
BAB I PENDAHULUAN	
1.1 Latar belakang	1
1.2 Rumusan Masalah	5
1.3 Pembatasan Masalah	6
1.4 Tujuan Penulisan	6
1.5 Manfaat Penulisan	7
BAB II LANDASAN TEORI	
2.1 Model Statistik Linier Umum dan Taksiran Parameternya	8
2.2 Model Statistik Linier Dengan Matriks Kovariansi Tak Diketahui	11
2.3 Penaksir non-linier <i>Least square</i>	14
2.4 Penaksir non-linier Maksimum Likelihood	16
2.5 Model <i>Time Series</i>	20

2.5.1 Kestasioneran Proses Stokastik	20
2.5.2 Fungsi Autokovariansi dan Autokorelasi	21
2.5.3 Proses <i>Autoregressive</i>	24

BAB III ARCH, GARCH DAN SV

3.1 Model ARCH	25
3.1.1 Fungsi Autokorelasi dari model ARCH	29
3.1.2 Hubungan antara kurtosis dengan fungsi Autokorelasi orde pertama untuk u_t^2 pada model ARCH(1)	31
3.1.3 Pengujian adanya efek model heteroskedastisitas pada data	32
3.2 Model GARCH	32
3.2.1 Kurtosis model GARCH	36
3.2.2 Fungsi Autokorelasi model GARCH (1,1)	38
3.2.3 Hubungan antara kurtosis dengan fungsi Autokorelasi orde pertama untuk u_t^2 pada model ARCH(1)	40
3.2.4 Penaksir Parameter model GARCH (1,1)	42
3.3 Model SV	44
3.3.1 Kurtosis model GARCH	45
3.3.2 Hubungan antara kurtosis dengan fungsi Autokorelasi orde pertama pada model SV	47

BAB IV STUDI KASUS

4.1 Perhitungan <i>Return</i>	51
4.2 Uji Karakteristik	53

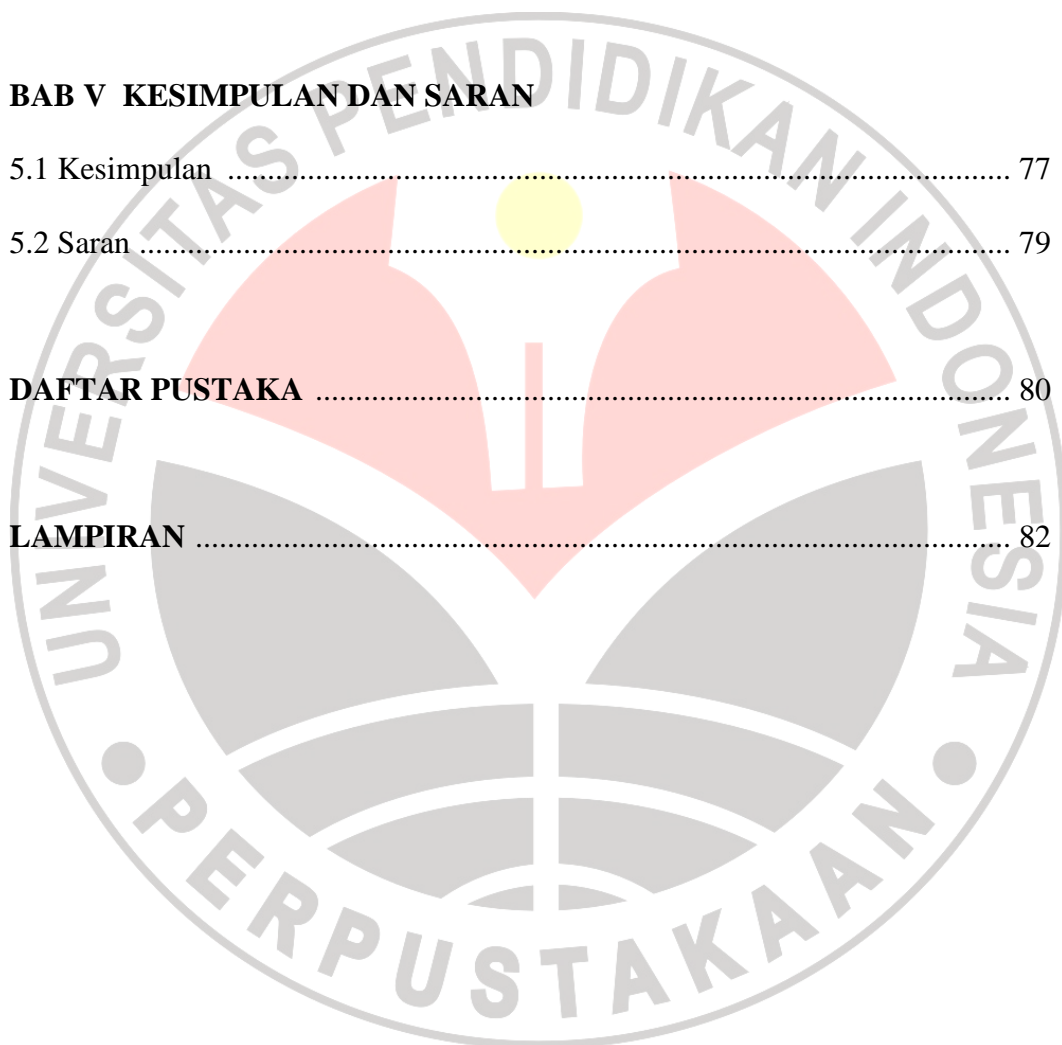
4.2.1 Uji Regularitas	53
4.3 Uji efek Heteroskedastisitas	54
4.4 Penentuan model yang paling dekat dengan data	56
4.5 Intepretasi model terhadap data	64
4.6 Peramalan	75

BAB V KESIMPULAN DAN SARAN

5.1 Kesimpulan	77
5.2 Saran	79

DAFTAR PUSTAKA	80
-----------------------------	----

LAMPIRAN	82
-----------------------	----



DAFTAR GAMBAR

Gambar 1 : Langkah Penelitian	52
Gambar 2 : Uji Karakteristik Data Return	53
Gambar 3 : Kurtosis dan autokorelasi orde 1 AUD	59
Gambar 4 : Kurtosis dan autokorelasi orde 1 CAD	60
Gambar 5 : Kurtosis dan autokorelasi orde 1 EURO	61
Gambar 6 : Kurtosis dan autokorelasi orde 1 USD	63
Gambar 7 : <i>Normality Residual</i> AUD	65
Gambar 8 : <i>Conditional standart deviation</i> AUD	67
Gambar 9 : <i>Normality Residual</i> CAD	67
Gambar 10 : <i>Conditional standart deviation</i> CAD	69
Gambar 11 : <i>Normality Residual</i> EURO	70
Gambar 12 : <i>Conditional standart deviation</i> EURO	72
Gambar 13 : <i>Normality Residual</i> USD	72
Gambar 14 : <i>Conditional standart deviation</i> USD	74

DAFTAR TABEL

Tabel 1 : <i>Correlogram of Residual AUD</i>	54
Tabel 2 : <i>Correlogram of Residual CAD</i>	55
Tabel 3 : <i>Correlogram of Residual EURO</i>	55
Tabel 4 : <i>Correlogram of Residual USD</i>	56
Tabel 5 : <i>Correlogram of squared Residual AUD</i>	65
Tabel 6 : <i>Estimation paramethric AUD</i>	66
Tabel 7 : <i>Correlogram of squared Residual CAD</i>	68
Tabel 8 : <i>Estimation paramethric CAD</i>	68
Tabel 9 : <i>Correlogram of squared Residual EURO</i>	70
Tabel 10 : <i>Estimation paramethric EURO</i>	71
Tabel 11 : <i>Correlogram of squared Residual USD</i>	73
Tabel 12 : <i>Estimation paramethric USD</i>	73
Tabel 13 : <i>Ramalan return</i>	75
Tabel 14 : <i>Ramalan nilai tukar mata uang asing terhadap rupiah</i>	75
Tabel 15 : <i>Nilai tukar mata uang sebenarnya</i>	76

DAFTAR LAMPIRAN

Lampiran 1 : Data nilai tukar mata uang asing terhadap rupiah	82
Lampiran 2 : Fungsi pembangkit momen v_t orde 4	98

