

## DAFTAR ISI

<b>HALAMAN JUDUL</b>	<b>i</b>
<b>HALAMAN PENGESAHAN</b>	<b>ii</b>
<b>HALAMAN PERNYATAAN</b>	<b>iii</b>
<b>HALAMAN PERSEMBAHAN</b>	<b>iv</b>
<b>HALAMAN MOTTO</b>	<b>v</b>
<b>PRAKATA</b>	<b>vi</b>
<b>DAFTAR ISI</b>	<b>viii</b>
<b>DAFTAR TABEL</b>	<b>x</b>
<b>DAFTAR LAMBANG</b>	<b>xiii</b>
<b>INTISARI</b>	<b>xiv</b>
<b>ABSTRACT</b>	<b>xv</b>
<b>I PENDAHULUAN</b>	<b>1</b>
1.1 Latar Belakang Masalah	1
1.2 Pembatasan Masalah	5
1.3 Perumusan Masalah	5
1.4 Tujuan dan Manfaat Penelitian	5
1.5 Tinjauan Pustaka	6
1.6 Metode Penelitian	8
1.7 Sistematika Penulisan	9
<b>II DASAR TEORI</b>	<b>11</b>
2.1 Ruang Hilbert Dasar	11
2.2 Fungsi Indikator	15
2.3 Distribusi Heavy Tailed	16
2.4 Konvergensi Variabel Random	19
2.5 Proses Linear	22
<b>III MODEL RCA(n) UNIVARIAT</b>	<b>41</b>
3.1 Uji Linearitas	41
3.1.1 Uji Tsay	41
3.1.2 Uji Terasvirta	42
3.1.3 Uji Data Surrogate	43
3.2 Uji Distribusi Heavy Tailed	45
3.2.1 Pengecekan Kurtosis	45
3.2.2 Estimator Hill	46

3.3	RCA(n)	46
3.3.1	RCA(1)	48
3.4	Penentuan Orde RCA(n)	93
<b>IV</b>	<b>PERCOBAAN</b>	<b>94</b>
4.1	Harga Penutupan Indeks RUSSELL	94
4.1.1	Preproses Data I	94
4.1.2	Pemodelan Untuk Data Latih I	98
4.1.3	Pemodelan Untuk Data Uji I	113
4.1.4	Peramalan I	115
4.2	Indeks Harga Konsumen	118
4.2.1	Preproses Data II	118
4.2.2	Pemodelan Untuk Data Latih II	122
4.2.3	Pemodelan Untuk Data Uji II	137
4.2.4	Peramalan II	139
4.3	Indeks Produksi: Indeks Total	142
4.3.1	Preproses Data III	142
4.3.2	Pemodelan Untuk Data Latih III	145
4.3.3	Pemodelan Untuk Data Uji III	158
4.3.4	Peramalan III	160
<b>V</b>	<b>KESIMPULAN</b>	<b>164</b>
5.1	Kesimpulan	164
5.2	Saran	169
	<b>DAFTAR PUSTAKA</b>	<b>170</b>
<b>A</b>	<b>Lampiran-Lampiran</b>	<b>173</b>
1.1	Latar Belakang Masalah	173
1.2	BAB II	176
1.3	BAB IV	177
1.3.1	Library	177
1.3.2	Fungsi Untuk Semua Data	178
1.3.3	Harga Penutupan Indeks RUSSELL	183
1.3.4	Indeks Harga Konsumen	213
1.3.5	Indeks Produksi: Indeks Total	242