



DAFTAR ISI

HALAMAN JUDUL	i
HALAMAN PENGESAHAN	ii
HALAMAN PERNYATAAN	iii
HALAMAN PERSEMBAHAN	iv
HALAMAN MOTTO	v
PRAKATA	vi
DAFTAR ISI	viii
DAFTAR TABEL	xi
DAFTAR LAMBANG	xii
INTISARI	xiii
ABSTRACT	xiv
I PENDAHULUAN	1
1.1 Latar Belakang Masalah	1
1.2 Perumusan Masalah	3
1.3 Pembatasan Masalah	4
1.4 Tujuan Penelitian	4
1.5 Tinjauan Pustaka	5
1.6 Metodologi Penelitian	7
1.6.1 Pengumpulan data	7
1.6.2 Persiapan data	8
1.6.3 Analisis Data	9
1.6.4 Evaluasi Model dan Perbandingan	9
1.6.5 Alat dan Software	10
1.7 Sistematika Penulisan	10
II LANDASAN TEORI	12
2.1 Ekonometrika	12
2.2 Konsep-konsep Dasar Runtun Waktu	13
2.3 Dekomposisi dan Penyesuaian Musiman	15
2.3.1 Komponen Tren	15
2.3.2 Komponen Musiman	15
2.3.3 Komponen Tren dan Musiman	16
2.4 Prapemrosesan Data Runtun Waktu	17
2.4.1 Model Stasioner	18



2.4.2	Visualisasi Stasioneritas Data Runtun Waktu	22
2.4.3	Uji Stasioneritas Data Runtun Waktu	23
2.4.4	Transformasi Data untuk Mengatasi Nonstasioneritas	26
2.5	MATRIKS	28
2.6	Model Regresi Linear dengan Pendekatan Matriks	31
2.6.1	Estimasi Ordinary Least Squares (OLS)	33
2.6.2	Meminimalkan Residual Sum of Squares (RSS)	34
2.7	Non-linear Least Square	36
2.7.1	Gradien Fungsi Objektif	37
2.7.2	Matriks Hessian Fungsi Objektif	38
2.7.3	Metode Newton dan Quasi-Newton	39
2.8	Data Frekuensi Campuran (<i>Mixed-Frequency Data</i>)	42
2.8.1	Notasi dan Satuan Waktu	42
2.8.2	Indeks Pengamatan Frekuensi Tinggi dalam Frekuensi Rendah	43
2.8.3	Kerangka Pemodelan Data Frekuensi Campuran	45
III ESTIMASI MODEL REGRESI MIDAS, DL-MIDAS, DAN ADL-MIDAS		47
3.1	Model Regresi U-MIDAS (Unrestricted MIDAS)	48
3.1.1	Estimasi Parameter Model U-MIDAS	49
3.1.2	Ilustrasi Estimasi Parameter Model U-MIDAS	52
3.2	Fungsi Bobot	57
3.3	Model Regresi DL-MIDAS	63
3.3.1	DL-MIDAS dengan $h_x = 1$	65
3.3.2	Perluasan DL-MIDAS dengan $h_x = 1$	67
3.3.3	Estimasi Parameter Model Regresi DL-MIDAS	69
3.4	Model Autoregressive Distributed Lag (ADL) MIDAS	71
3.4.1	Penyelarasan dengan Dua Frekuensi Tinggi Berbeda	73
3.4.2	Model ADL-MIDAS dengan Fungsi Bobot	75
3.4.3	Estimasi Parameter Model ADL-MIDAS	76
IV STUDI KASUS		78
4.1	Indeks Harga Konsumen (IHK)	79
4.2	Variabel Independen	82
4.3	Estimasi Parameter Model MIDAS	89
4.3.1	Model U-MIDAS	89
4.3.2	Model DL-U-MIDAS	92
4.3.3	Model ADL-U-MIDAS	96



4.3.4	Model MIDAS Almon	98
4.3.5	Model DL-MIDAS	100
4.3.6	Model ADL-MIDAS Almon	101
4.3.7	Model AR-1 dan Model Regresi Agregat	104
4.3.8	Perbandingan Evaluasi Model MIDAS dan Model <i>benchmark</i>	106
V	KESIMPULAN	108
5.1	Kesimpulan	108
5.2	Saran	109
A	Data Harga Minyak Mentah Dunia (WTI)	114
B	Data Imbal Hasil (Yield) Obligasi	118
C	Data Nilai Tukar Mata Uang (Kurs)	120
D	Data Indeks Harga Saham Gabungan (IHSG)	122
E	Data Suku Bunga Antar Bank Jakarta (JIBOR)	124