

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 GAMBAR	xv
INTISARI	xvii
ABSTRACT	xviii
I PENDAHULUAN	1
1.1 Latar Belakang	1
1.2 Rumusan Masalah	6
1.3 Batasan Masalah	6
1.4 Tujuan Penelitian	7
1.5 Manfaat Penelitian	7
1.6 Tinjauan Pustaka	7
1.7 Metode Penelitian	9
1.8 Sistematika Penulisan	9
II DASAR TEORI	11
2.1 Harga Harapan	11
2.2 Variansi dan Kovariansi	13
2.3 Korelasi	17
2.4 Distribusi Bersyarat	17
2.5 Ekspektasi dan Variansi Bersyarat	18
2.6 Momen	21
2.7 Distribusi Normal dan Sifatnya	23

2.7.1	Distribusi Normal	23
2.7.2	Kurtosis	24
2.8	Data Multivariat	25
2.9	Vektor Mean dan Matriks Kovariansi	26
2.10	Distribusi Normal Multivariat	29
2.11	Jenis Data Menurut Waktu	31
2.12	Klasifikasi Model Runtun Waktu	32
2.13	Proses Stokastik	33
2.14	Proses <i>White Noise</i>	34
2.15	Model <i>Autoregressive</i> (AR)	34
2.16	Kestasioneran Data Deret Waktu	35
2.16.1	Plot Data	36
2.16.2	Uji Akar Unit (<i>Unit Root Test</i>)	38
2.17	<i>Autocorrelation Function</i> (ACF) dan <i>Partial Autocorrelation Function</i> (PACF)	40
2.18	Model <i>Vector Autoregressive</i> (VAR)	40
2.19	Model <i>Space Time Autoregressive</i> (STAR)	42
2.20	Inflasi	45
III	MODEL GSTAR-ARCH	47
3.1	Model <i>Generalized Space Time Autoregressive</i> (STAR)	47
3.1.1	Pemilihan Bobot Lokasi Model GSTAR	49
3.1.2	Estimasi Parameter Model GSTAR	52
3.2	Model Heteroskedastik	56
3.2.1	Model untuk <i>Mean</i>	58
3.2.2	Model untuk Volatilitas	59
3.2.3	Model ARCH(1)	61
3.3	Pengujian Asumsi Residual	63
3.3.1	Uji Korelasi Serial	63
3.3.2	Uji Homoskedastisitas	64
3.4	Kriteria Pemilihan Model Terbaik	67

3.5	Langkah-Langkah Analisis Runtun Waktu Menggunakan Model	
	GSTAR -ARCH	68
IV	STUDI KASUS	70
4.1	Statistika Deskriptif	70
4.2	Pemodelan Data Inflasi di Jabodetabek	73
4.2.1	Kestasioneran Data Inflasi	74
4.2.2	Identifikasi Orde Model GSTAR-ARCH	75
4.2.3	Bobot Lokasi Model GSTAR	76
4.2.4	Penaksiran Parameter Model GSTAR-ARCH	82
	4.2.4.1 Penaksiran Parameter Model GSTAR(2 ₁)	82
	4.2.4.2 Penaksiran Variansi Bersyarat dari Residual	
	Model GSTAR(2 ₁)	88
4.2.5	Uji Diagnostik Model GSTAR(2 ₁)-ARCH(1)	95
	4.2.5.1 Uji Korelasi Serial Residual Model GSTAR(2 ₁)	97
	4.2.5.2 Uji Diagnostik Model ARCH(1)	98
4.2.6	Pemilihan Model Terbaik	100
4.3	Peramalan Data Inflasi di Jabodetabek dengan Model	
	GSTAR(2 ₁)-ARCH(1) Bobot Seragam	104
4.4	Pemodelan Data Indeks Saham Indonesia, Jepang, dan Filipina	108
V	PENUTUP	134
5.1	Kesimpulan	134
5.2	Saran	136
	DAFTAR PUSTAKA	137
	LAMPIRAN	141