

## DAFTAR ISI

HALAMAN JUDUL .....	i
HALAMAN PENGESAHAN .....	ii
HALAMAN PERNYATAAN.....	iii
HALAMAN PERSEMBAHAN .....	iv
HALAMAN MOTTO .....	v
PRAKATA .....	vi
DAFTAR ISI .....	viii
DAFTAR GAMBAR .....	x
DAFTAR TABEL .....	xi
INTISARI.....	xii
ABSTRACT .....	xiii
1. PENDAHULUAN .....	1
1.1 Latar Belakang Masalah .....	1
1.2 Tujuan Dan Manfaat Penelitian.....	5
1.3 Pembatasan Masalah.....	5
1.4 Tinjauan Pustaka .....	5
1.5 Metode Penelitian.....	6
1.6 Sistematika Penulisan .....	6
2. LANDASAN TEORI.....	8
2.1 Data.....	8
2.1.1 Tingkat Suku Bunga .....	8
2.1.2 Tingkat Inflasi .....	10
2.1.3 Hubungan Antara Tingkat Suku Bunga dan Tingkat Inflasi.....	13
2.2 Peramalan.....	15
2.3 Konsep dasar <i>Time Series</i> (Runtun Waktu).....	16
2.4 Stasioneritas dan Non Stasioneritas.....	19
2.5 Proses <i>White Noise</i> .....	22
2.6 Fungsi Autokorelasi dan Fungsi Autokorelasi Parsial .....	22
2.7 Proses <i>Autoregressive (AR)</i> , <i>Moving Average (MA)</i> , dan <i>Autoregressive Moving Average (ARMA)</i> .....	25
2.8 <i>Vector Autoregressive (VAR)</i> dan <i>Vector Moving Average (VMA)</i> .....	33
2.9 <i>Cross-Covariance</i> dan <i>Cross-Correlation</i> Matriks.....	35
2.10 Uji <i>Dickey-Fuller (DF)</i> .....	37
2.11 Kriteria Informasi .....	38
3. PERAMALAN MODEL VARMA.....	39
3.1 Model Runtun Waktu Multivariat .....	39
3.2 Model VARMA.....	40
3.3 Metode Penelitian.....	43
3.4 Stasioneritas Data .....	45
3.5 Tahap-tahap Pemodelan VARMA .....	46
3.5.1 Tahap 1 (Identifikasi Orde Model) .....	46
3.5.2 Tahap 2 (Estimasi Parameter Model).....	48

3.5.3 Tahap 3 (Pemeriksaan Diagnostik Model) .....	51
3.6 Metode Peramalan VARMA.....	52
3.7 Evaluasi Hasil Peramalan .....	53
4. STUDI KASUS .....	55
4.1 Data.....	55
4.2 Stasioneritas Data .....	57
4.3 Identifikasi Model VARMA .....	60
4.4 Estimasi Model VARMA .....	61
4.5 Uji Diagnostik Model VARMA.....	63
4.6 Peramalan.....	65
4.6.1 Peramalan Data Tingkat Suku Bunga Bank Indonesia .....	67
4.6.2 Peramalan Data Tingkat Inflasi di Indonesia .....	71
4.7 Analisis Hasil Peramalan .....	73
5. PENUTUP .....	76
5.1 Kesimpulan .....	76
5.2 Saran .....	77
DAFTAR PUSTAKA .....	78
LAMPIRAN .....	80