

## DAFTAR ISI

<b>HALAMAN JUDUL.</b>	i
<b>HALAMAN PERSETUJUAN.</b>	ii
<b>HALAMAN PERNYATAAN.</b>	iii
<b>HALAMAN PERSEMBAHAN.</b>	iv
<b>HALAMAN MOTTO.</b>	v
<b>PRAKATA.</b>	vi
<b>DAFTAR ISI.</b>	viii
<b>DAFTAR GAMBAR.</b>	xi
<b>DAFTAR TABEL</b>	xii
<b>INTISARI.</b>	xiii
<b>ABSTRACT.</b>	xiv
<b>BAB I     PENDAHULUAN</b>	
1.1     Latar Belakang	1
1.2     Perumusan Masalah	3
1.3     Pembatasan Masalah	3
1.4     Tujuan Penelitian	3
1.5     Metodologi Penelitian	4
1.6     Tinjauan Pustaka	4
1.7     Sistematika Penulisan	5
<b>BAB II     LANDASAN TEORI</b>	
2.1     Teori Probabilitas	7
2.2     Variabel Random	8
2.3     Proses Stokastik	9
2.4     Stasioneritas Data Runtun Waktu	12
2.5     Operator <i>Backshift</i> dan Operator Diferensi	14
2.6     Ketidakstasioneran	15
2.6.1 <i>Differencing</i>	15

2.6.2	Transformasi <i>Box - Cox</i> .....	17
2.6.3	Uji <i>Augmented Dickey Fuller Test</i> (ADF) .....	18
2.7	Proses <i>White Noise</i> .....	19
2.8	Norm suatu Vektor .....	20
2.9	Matriks Simetris dan Matriks Definit Positif .....	20
2.10	Model yang mendasari model MIDAS .....	21
2.10.1	Model Distribusi <i>Lag</i> .....	21
2.10.2	Pendekatan Almon untuk Model Distribusi <i>Lag</i> .....	22
2.10.3	Model Regresi MIDAS .....	25
2.10.3.1	Penentuan Parameter Fungsi Bobot .....	26
2.11	Fungsi Konveks .....	26
2.11.1	Diferensial Dua Kali dari Fungsi Konveks .....	27
2.11.2	Meminimumkan Fungsi Konveks .....	30
2.12	Model <i>Nonlinear Least Square</i> (NLS) .....	32
2.12.1	Metode Quasi Newton dengan Algoritma BFGS .....	33
2.13	Kriteria Informasi .....	34
2.14	Peramalan .....	34
<b>BAB III</b>	<b>ESTIMASI MODEL REGRESI MIDAS MENGGUNAKAN METODE NLS DENGAN ALGORITMA BFGS</b>	
3.1	Model Regresi MIDAS .....	36
3.2	Estimasi Parameter Model Regresi MIDAS .....	43
3.3	Peramalan .....	47
<b>BAB IV</b>	<b>STUDI KASUS</b>	
4.1	Jenis dan Sumber Data .....	49
4.2	Deskripsi Data .....	50
4.3	Estimasi Parameter .....	58
4.4	Perbandingan Model Regresi MIDAS dan Model Distribusi <i>Lag</i> .....	62
4.5	Peramalan Laju Pertumbuhan PDB Indonesia .....	65
<b>BAB V</b>	<b>PENUTUP</b>	

5.1	Kesimpulan .....	68
5.2	Saran .....	68
<b>DAFTAR PUSTAKA .....</b>		<b>70</b>
<b>LAMPIRAN.....</b>		<b>72</b>