

DAFTAR ISI

	Halaman
Lembar Pengesahan	<i>i</i>
Riwayat Hidup	<i>ii</i>
Abstrak	<i>iii</i>
Kata Pengantar	<i>iv</i>
Daftar Isi	<i>v</i>
Daftar Gambar	<i>viii</i>
Daftar Tabel	<i>ix</i>
Daftar Lampiran	<i>x</i>
BAB I PENDAHULUAN	
1.1 Latar Belakang	1
1.2 Rumusan Masalah	3
1.3 Pembatasan Masalah	3
1.4 Tujuan Penelitian	4
1.5 Manfaat Penelitian	4
BAB II LANDASAN TEORI	
2.1 Inflasi	5
2.1.1 Definisi Inflasi	5
2.1.2 Faktor-faktor yang Mempengaruhi Inflasi di Indonesia	6
2.1.3 Jenis-jenis Inflasi	6
2.1.4 Inflasi di Indonesia	8
2.2 Heteroskedastisitas	9
2.3 Stasioneritas	10
2.4 Fungsi Autokorelasi (ACF)	12
2.5 Fungsi Parsial Autokorelasi (PACF)	13
2.6 Proses <i>White Noise</i>	14
2.7 Model Umum Deret Waktu	14

2.7.1	Model <i>Autoregressive</i> (AR)	14
2.7.2	Model <i>Moving Average</i> (MA)	15
2.7.3	Model <i>Autoregressive Moving Average</i> (ARMA)	15
2.8	Model Deret Waktu Data Ekonomi dan Keuangan	16
2.8.1	Model <i>Autoregressive Conditional Heteroscedastic</i> (ARCH)	17
2.8.2	Model <i>Generalized Autoregressive Conditional Heteroscedastic</i> (GARCH)	19
2.9	Data <i>Log Return</i>	20
2.10	Model GARCH(1,1)	21
2.11	Fungsi Autokorelasi (ACF) untuk Kuadrat Sisaan (ε_t^2)	22
2.11.1	Statistik <i>Ljung-Box Q</i>	23
2.12	Fungsi Autokorelasi (ACF) untuk Sisaan yang Dibakukan	24
2.13	Pembentukan Model GARCH(1,1)	24
2.14	Analisis GARCH Menggunakan EVIEWS	25
2.15	Peramalan Model GARCH	29
BAB III METODE PENELITIAN		
3.1	Tempat dan Waktu Penelitian	31
3.2	Sumber Data	31
3.3	Prosedur Penelitian	32
BAB IV PEMBAHASAN		
4.1	Data Awal	34
4.2	Identifikasi Model	34
4.3	Penaksiran Parameter Model GARCH	39
4.4	Uji Model	40
4.5	Peramalan dengan Model GARCH	41
BAB V KESIMPULAN DAN SARAN		
5.1	Kesimpulan	44
5.2	Saran	44



THE
Character Building
UNIVERSITY