

DAFTAR ISI

INTISARI.....	i
ABSTRACT	ii
PRAKATA	iii
DAFTAR ISI.....	v
DAFTAR TABEL.....	vii
DAFTAR GAMBAR.....	viii
DAFTAR SIMBOL	ix
BAB I PENDAHULUAN	1
1.1. Latar Belakang.....	1
1.2. Rumusan Masalah.....	4
1.3. Tujuan Penelitian	4
1.4. Batasan Masalah	4
1.5. Tinjauan Pustaka.....	4
1.6. Metodologi Penelitian.....	6
BAB II LANDASAN TEORI	9
2.1 Data Deret Waktu	9
2.2 Kurs Mata Uang.....	9
2.3 Volatilitas	10
2.4 <i>Return</i>	10
2.5 Stasioneritas.....	11
2.6 Model <i>Autoregressive</i> (AR).....	12
2.7 Model <i>Moving Average</i> (MA).....	13
2.8 Model <i>Autoregressive Moving Average</i> (ARMA).....	13
2.9 <i>Autoregressive Conditional Heteroscedasticity</i> (ARCH).....	14
BAB III DYNAMIC CONDITIONAL CORRELATION MGARCH	15
3.1 Model <i>Generalized Autoregressive Conditional Heteroscedasticity</i> (GARCH).....	15
3.2 Korelasi.....	16
3.3 Model Multivariat GARCH	16
3.4 Model <i>Dynamic Conditional Correlation</i> (DCC) MGARCH	18
3.5 Uji Normalitas	20
3.6 Uji Autokorelasi.....	20
3.7 Uji Heteroskedastisitas	21

3.8	Akurasi Model DCC-MGARCH.....	21
BAB IV HASIL DAN PEMBAHASAN.....		23
4.1	Deskripsi Data	23
4.2	Uji Kestasioneran Data	24
4.3	Pembentukan Model ARMA	25
4.4	Pemodelan GARCH.....	27
4.5	Pemodelan Multivariat GARCH.....	29
4.6	Validasi Model DCC-MGARCH.....	34
BAB V KESIMPULAN.....		37
DAFTAR PUSTAKA		38
LAMPIRAN.....		41