

DAFTAR ISI

HALAMAN JUDUL	ii
HALAMAN PENGESAHAN I	iii
HALAMAN PENGESAHAN II.....	iv
KATA PENGANTAR.....	v
ABSTRAK	vi
ABSTRACT	vii
DAFTAR ISI.....	viii
DAFTAR TABEL	xi
DAFTAR GAMBAR.....	xii
DAFTAR LAMPIRAN	xiii
BAB I PENDAHULUAN.....	1
1.1 Latar Belakang	1
1.2 Rumusan Masalah	5
1.3 Batasan Masalah.....	5
1.4 Tujuan Penelitian	6
BAB II TINJAUAN PUSTAKA.....	7
2.1 Saham.....	7
2.2 Analisis Runtun Waktu	9
2.3 Stasioneritas Deret Waktu.....	10
2.3.1 Transformasi Box-Cox.....	11
2.3.2 Uji Akar Unit <i>Augmented Dickey Fuller</i> (ADF).....	15
2.3.3 Fungsi Autokorelasi (ACF).....	17
2.3.4 Fungsi Autokorelasi Parsial (PACF).....	18

2.4 Model Umum Runtun Waktu.....	20
2.4.1 Model <i>Autoregressive</i> (AR)	21
2.4.2 Model <i>Moving Average</i> (MA).....	21
2.4.3 Model <i>Autoregressive Moving Average</i> (ARMA)	22
2.4.4 Model <i>Autoregressive Integrated Moving Average</i> (ARIMA)	22
2.4.5 Model Subset <i>Autoregressive Moving Average</i> (ARMA)	23
2.5 Permodelan Runtun Waktu Metode <i>Box-Jenkins</i>	23
2.5.1 Identifikasi Model Runtun Waktu.....	24
2.5.2 Estimasi Parameter Model ARIMA	24
2.5.3 Uji Signifikansi Parameter Model ARIMA	27
2.5.4 Uji Normalitas Residual	29
2.5.5 Uji Independensi Residual	30
2.6 Pemilihan Model Terbaik.....	31
2.7 Uji <i>Autoregressive Conditional Heteroscedasticity Lagrange Multiplier</i> (ARCH-LM)	32
2.8 Model <i>Generalized Autoregressive Conditional Heteroscedasticity</i> (GARCH).....	34
2.8.1 Estimasi Parameter GARCH.....	35
2.8.2 Uji Signifikansi Parameter Model GARCH.....	38
2.9 Model ARIMA-GARCH (<i>Autoregressive Integrated Moving Average –</i> <i>Generalized Autoregressive Conditional Heteroskedasticity</i>).....	39
2.10 Ukuran Ketepatan Prediksi	40
BAB III METODOLOGI PENELITIAN	42
3.1 Jenis dan Sumber Data	42
3.2 Variabel Penelitian	42
3.3 Tahapan Analisis Data	42
3.4 Diagram Alir Analisis Data.....	44
BAB IV HASIL DAN PEMBAHASAN	48
4.1 Analisis Deskriptif Data.....	48

4.2 Stasioneritas	50
4.2.1 Transformasi Box-Cox.....	50
4.2.2 Uji Akar Unit <i>Augmented Dickey-Fuller</i> (ADF)	50
4.3 Identifikasi Model ARIMA.....	51
4.4 Estimasi dan Uji Signifikansi Parameter Model ARIMA.....	52
4.5 Uji Asumsi Model.....	55
4.5.1 Uji Normalitas Residual.....	56
4.5.2 Uji Independensi Residual	57
4.6 Uji Non Heteroskedaktisitas	61
4.7 Pemilihan Model ARIMA Terbaik	62
4.8 Estimasi dan Signifikansi Parameter Model GARCH	64
4.9 Pemilihan Model ARIMA-GARCH Terbaik.....	67
4.10 Uji Lagrange Multiplier Model ARIMA-GARCH	68
4.11 Peramalan <i>Return</i> dan Volatilitas.....	69
BAB V PENUTUP	80
5.1 Kesimpulan	80
5.2 Saran.....	81
DAFTAR PUSTAKA	82
LAMPIRAN.....	85