

DAFTAR ISI

HALAMAN JUDUL.....	i
HALAMAN PENGESAHAN I	ii
HALAMAN PENGESAHAN II.....	iii
KATA PENGANTAR	iv
ABSTRAK	v
ABSTRACT.....	vi
DAFTAR ISI.....	vii
DAFTAR GAMBAR	ix
DAFTAR TABEL.....	x
DAFTAR LAMPIRAN.....	xi
BAB I PENDAHULUAN.....	1
1.1. Latar Belakang	1
1.2. Rumusan Masalah	6
1.3. Batasan Masalah.....	6
1.4. Tujuan Penelitian.....	7
BAB II TINJAUAN PUSTAKA.....	8
2.1. Pasar Modal dan Saham	8
2.2. Peramalan	10
2.3. Analisis Runtun Waktu	11
2.3.1. Stasioneritas dalam Varian.....	12
2.3.2. Stasioneritas Dalam Mean.....	12
2.4. Autokorelasi dan Autokorelasi Parsial	14
2.4.1. Fungsi Autokorelasi (ACF).....	14
2.4.2. Fungsi Autokorelasi Parsial (PACF).....	15
2.5. Model Runtun Waktu Stasioner	15
2.5.1. Model Autoregressive (AR).....	16
2.5.2. Model Moving Average (MA)	17
2.5.3. Model Autoregressive Moving Average (ARMA).....	18
2.6. Model Runtun Waktu Nonstasioner	19
2.6.1. Model Autoregressive Integrated Moving Average (ARIMA).....	19
2.6.2. Model ARFIMA	20
2.7. Prosedur Pemodelan ARFIMA	21
2.7.1. Identifikasi Pola <i>Long Memory</i>	21
2.7.2. Estimasi Parameter pembeda (d) dengan Metode GPH	23
2.7.3. Estimasi Parameter Model ARFIMA (p,d,q)	26
2.7.4. Uji Parameter Model	27
2.8. Uji Asumsi Model	27
2.8.1. Asumsi Uji Normalitas Residual	27
2.8.2. Proses White Noise.....	28
2.8.3. Asumsi Non Heterokedastisitas Residual.....	29
2.9. Model Terbaik	30
2.10. Model ARCH dan GARCH.....	32
2.11. Model ARCH (Autoregressive Conditional Heterokedasticity)	32
2.11.1. Model GARCH.....	33
2.12. Model ARFIMA-GARCH.....	34
BAB III METODOLOGI PENELITIAN.....	33

3.1. Jenis dan Sumber Data	33
3.2. Variabel Penelitian	33
3.3. Langkah Analisis	33
3.4. Diagram Alir Penelitian.....	35
BAB IV HASIL DAN PEMBAHASAN	38
4.1. Deskripsi Data	38
4.2. Uji Stasioneritas Data.....	39
a. Stasioneritas dalam Varian	39
b. Stasioneritas dalam <i>Mean</i>	41
4.3. Pengujian Pola <i>Long Memory</i>	42
4.4. Pengujian Estimasi Parameter (d) dengan Metode GPH.....	46
4.5. Identifikasi Model	47
4.6. Estimasi Parameter	49
4.7. Pengujian Asumsi Model	50
4.8. Model Terbaik ARFIMA.....	53
4.9. Identifikasi dan Estimasi Model GARCH.....	54
4.10. Asumsi Non Heterokedastisitas Residual Model Akhir.....	57
4.11. Peramalan	57
BAB V PENUTUP.....	61
5.1. Kesimpulan.....	61
5.2. Saran.....	61
DAFTAR PUSTAKA	63
LAMPIRAN.....	66