

## DAFTAR ISI

	<b>Halaman</b>
<b>ABSTRAK</b> .....	i
<b>KATA PENGANTAR</b> .....	ii
<b>UCAPAN TERIMAKASIH</b> .....	iii
<b>DAFTAR ISI</b> .....	v
<b>DAFTAR TABEL</b> .....	ix
<b>DAFTAR GAMBAR</b> .....	xi
<b>DAFTAR LAMPIRAN</b> .....	xii
<b>DAFTAR SIMBOL</b> .....	xiii
<b>BAB 1 PENDAHULUAN</b>	
<b>1.1 Latar Belakang Masalah</b> .....	1
<b>1.2 Rumusan Masalah</b> .....	3
<b>1.3 Tujuan Penulisan</b> .....	4
<b>1.4 Manfaat Penulisan</b> .....	4
<b>1.5 Sistematika Penulisan</b> .....	4
<b>BAB 2 LANDASAN TEORI</b>	
<b>2.1 Model Runtun Waktu</b> .....	6
<b>2.2 Proses Stasioner</b> .....	6
<b>2.3 Fungsi Autokorelasi dan Autokorelasi Parsial</b> .....	7
<b>2.4 Proses <i>White Noise</i></b> .....	8

<b>2.5 Metode Runtun Waktu Box-Jenkins Stasioner</b> .....	9
<b>2.5.1 Proses Autoregressive (AR)</b> .....	9
<b>2.5.2 Proses Moving Average (MA)</b> .....	10
<b>2.5.3 Proses Campuran Autoregressive Moving Average (ARMA)</b> .....	10
<b>2.6 Metode Runtun Waktu Box-Jenkins Nonstasioner</b> .....	11
<b>2.7 Pembentukan Model Runtun Waktu Box-Jenkins</b> .....	12
<b>2.7.1 Pemeriksaan Kestasioneran Data Runtun Waktu</b> .....	12
<b>2.7.2 Identifikasi Model</b> .....	13
<b>2.7.3 Estimasi Parameter</b> .....	14
<b>2.7.4 Verifikasi Model</b> .....	14
<b>2.7.5 Peramalan</b> .....	16
<b>2.8 Saham</b> .....	17
<b>2.9 Return Saham</b> .....	17
<b>2.10 Volatilitas</b> .....	19
<b>2.10.1 Model Volatilitas Autoregressive Conditional Heteroscedastic (ARCH)</b> .....	20
<b>2.10.2 Model Volatilitas Generalized Autoregressive Conditional Heteroscedastic (GARCH)</b> .....	22
<b>2.10.3 Uji Efek ARCH</b> .....	23
<b>2.10.4 Model Volatilitas Random Coefficient Autoregressive (RCA)</b> ....	24

## **BAB 3 CONDITIONAL HETEROSCEDASTIC AUTOREGRESSIVE**

### **MOVING AVERAGE (CHARMA)**

<b>3.1 Model <i>Conditional Heteroscedastic Autoregressive Moving Average</i></b> <b>(CHARMA)</b> .....	26
<b>3.2 Tahap Pembentukan Model CHARMA</b> .....	28
<b>3.3 Identifikasi Model</b> .....	29
<b>3.4 Estimasi Parameter</b> .....	30
<b>3.4.1 Metode Newton-Raphson</b> .....	33
<b>3.4.2 <i>Method of Scoring</i></b> .....	34
<b>3.4.3 Metode Iterasi Berndt, Hall, Hall, and Hausman (IBHHH)</b> .....	34
<b>3.5 Verifikasi Model</b> .....	35
<b>3.6 Peramalan</b> .....	36
<b>BAB 4 STUDI KASUS</b>	
<b>4.1 Data</b> .....	38
<b>4.2 Stasioneritas <i>Return Saham</i></b> .....	39
<b>4.3 Pembentukan Model Box-Jenkins</b> .....	41
<b>4.3.1 Identifikasi Model</b> .....	41
<b>4.3.2 Estimasi Parameter</b> .....	43
<b>4.3.3 Verifikasi Model Box-Jenkins</b> .....	44
<b>4.3.3.1 Uji Keberartian Koefisien</b> .....	45
<b>4.3.3.2 Uji Kecocokan</b> .....	46
<b>4.3.3.3 Nilai variansi Sesatan</b> .....	47
<b>4.4 Uji Heteroskedastisitas</b> .....	47
<b>4.5 Pembentukan Model CHARMA</b> .....	49
<b>4.5.1 Identifikasi Model</b> .....	49

4.5.2 Estimasi Parameter .....	49
4.5.3 Verifikasi Model .....	52
4.5.3.1 Uji Keberartian Koefisien .....	52
4.5.3.2 Perbandingan Nilai AIC dan SC .....	53
4.5.4 Peramalan .....	54
<b>BAB 5 PENUTUP</b>	
5.1 Kesimpulan .....	57
5.2 Saran .....	58
<b>DAFTAR PUSTAKA</b>	
<b>LAMPIRAN</b>	
<b>RIWAYAT HIDUP</b>	