

DAFTAR ISI

LEMBAR PENGESAHAN	
PERNYATAAN	i
ABSTRAK	ii
ABSTRACT	iii
KATA PENGANTAR	iv
UCAPAN TERIMA KASIH	v
DAFTAR ISI	vii
DAFTAR TABEL	x
DAFTAR GAMBAR	xi
DAFTAR LAMPIRAN	xiii
BAB I PENDAHULUAN	1
1.1 Latar Belakang	1
1.2 Rumusan Masalah	3
1.3 Tujuan Penelitian	3
1.4 Manfaat Penelitian	3
1.5 Batasan Masalah	4
BAB II KAJIAN PUSTAKA	5
2.1 Pasar Modal.....	5
2.2 Indeks Harga Saham.....	5
2.3 Data Runtun Waktu.....	6
2.4 Stasioneritas.....	7
2.5 FAK dan FAKP.....	9
2.6 Proses <i>White Noise</i>	10
2.7 Identifikasi Model	11
2.8 Estimasi Model.....	13

2.9 Uji Diagnosis Model	14
2.10 Pemilihan Model Terbaik.....	15
2.11 Heteroskedastisitas	15
2.12 Model <i>Autoregressive Conditional Heteroskedasticity</i> (ARCH).....	15
2.13 Uji Efek ARCH	16
2.14 Peramalan	18
BAB III PEMODELAN ARIMAX-GARCH.....	20
3.1 Model ARIMAX	20
3.1.1 Identifikasi Model ARIMAX	22
3.1.2 Estimasi Model ARIMAX	24
3.1.3 Pengujian Diagnostik ARIMAX	25
3.2 Model GARCH (<i>Generalized Autoregressive Conditional</i> <i>Heteroskedasticity</i>).....	26
3.2.1 Estimasi Parameter Model GARCH	27
3.2.2 Uji Diagnosis Model GARCH	28
3.3 Pemodelan ARIMAX-GARCH.....	28
BAB IV STUDI KASUS	30
4.1 Identifikasi Model ARIMAX.....	30
4.1.1 Mempersiapkan Deret Input dan Output	30
4.1.2 Identifikasi Model ARIMA dari Deret Input	37
4.1.3 Pemutihan Deret Input dan Deret Output.....	43
4.1.4 Perhitungan Korelasi Silang Deret Input dan Deret Output yang Telah Diputihkan.....	45
4.1.5 Penaksir Langsung Bobot Respom Impuls	47
4.1.6 Menentukan Nilai Orde (r,s,b) untuk Model ARIMAX	47
4.1.7 Penaksiran Awal Deret Gangguan <i>Noise</i> (n_t)	48
4.1.8 Penetapan Model ARIMA($p_n,0,q_n$) dari Deret Gangguan <i>Noise</i> (n_t)	48

4.2	Estimasi Parameter Model ARIMAX.....	50
4.3	Pengujian Dignostik ARIMAX	51
4.3.1	Pengujian Autokorelasi untuk Residual.....	51
4.3.2	Perhitungan Korelasi Silang antara Nilai Sisa dengan Deret Input yang Telah Diputihkan.....	52
4.4	Uji <i>Lagrange Multiplier</i> pada ARIMAX(0,0,0).....	53
4.5	Estimasi Parameter ARIMAX-GARCH.....	54
4.6	Uji Diagnosis ARIMAX-GARCH.....	56
4.7	Pemilihan Model Terbaik ARIMAX-GARCH.....	61
4.8	Peramalan.....	62
 BAB V KESIMPULAN DAN SARAN		65
5.1	Kesimpulan	65
5.2	Saran	65
 DAFTAR PUSTAKA		67
 LAMPIRAN		69