

DAFTAR ISI

LEMBAR PERSETUJUAN	ii
LEMBAR PENGESAHAN.....	iii
PERNYATAAN KEASLIAN SKRIPSI.....	iv
PERNYATAAN PERSETUJUAN PUBLIKASI SKRIPSI.....	v
ABSTRAK.....	vi
ABSTRACT.....	vii
KATA PENGANTAR.....	viii
DAFTAR ISI	x
DAFTAR GAMBAR.....	xii
DAFTAR TABEL	xiv
BAB I PENDAHULUAN	1
1.1 Latar Belakang.....	1
1.2 Rumusan Masalah.....	3
1.3 Batasan Masalah	4
1.4 Tujuan Penelitian.....	4
1.5 Metode Penelitian	5
1.6 Sistematika Penulisan	5
BAB II LANDASAN TEORI.....	7
2.1 Investasi	7
2.2 Saham.....	9
2.3 Pasar Modal.....	11
2.4 Risiko	12
2.5 <i>Return</i>	13
2.6 Peramalan	14
2.7 Volatilitas	15
2.8 Ukuran Sebaran Data	16
2.9 <i>Mean Absolute Percentage Error (MAPE)</i>	18
2.10 Kestasioneran	19
2.11 <i>Covariance Stationary</i>	20
2.12 <i>Autocorrelation Function (ACF)</i>	21

2.13	<i>Partial Autocorrelation Function (PACF)</i>	22
2.14	Proses <i>White Noise</i>	23
2.15	Proses <i>Autoregressive (AR)</i>	24
2.16	Proses <i>Moving Average (MA)</i>	27
BAB III	METODE PENELITIAN	30
3.1	<i>Value at-Risk</i>	30
3.2	Model <i>Autoregressive Moving Average (ARMA)</i>	32
3.3	Model <i>ARMAX</i>	33
3.4	Model <i>General Autoregressive Conditional Heteroscedasticity (GARCH)</i>	38
3.5	Estimasi <i>Value at-Risk (VaR)</i> pada Hasil Peramalan Model <i>ARMAX-GARCH</i>	41
BAB IV	STUDI KASUS DAN ANALISA	47
4.1	Deskripsi Data	47
4.2	<i>Return</i> Harga Penutupan Saham.....	52
4.3	Uji Kestasioneran	55
4.4	Pemodelan <i>ARMAX-GARCH</i>	56
4.5	Estimasi <i>Value at-Risk</i>	87
4.6	Uji <i>Backtesting</i>	93
BAB V	PENUTUP	96
5.1	Kesimpulan.....	96
5.2	Saran	97
DAFTAR PUSTAKA		98
LAMPIRAN		