

DAFTAR ISI

INTISARI	i
ABSTRACT.....	ii
PRAKATA.....	iii
DAFTAR ISI	v
DAFTAR TABEL	vii
DAFTAR GAMBAR.....	viii
DAFTAR SIMBOL	ix
BAB I	1
PENDAHULUAN	1
1.1 Latar Belakang.....	1
1.2 Rumusan Masalah	3
1.3 Tujuan Penelitian.....	3
1.4 Batasan Masalah.....	3
1.5 Tinjauan Pustaka	3
1.6 Metodologi Penelitian	4
BAB II.....	7
LANDASAN TEORI.....	7
2.1. Konsep Dasar Deret Waktu	7
2.2. Indeks Harga Saham Gabungan	7
2.3. Volatilitas	7
2.4. Return	8
2.5. Stasioneritas Data	8
2.6. Model Autoregressive (AR)	9
2.7. Model Moving Average (MA)	10
2.8. Model Autoregressive Moving Average (ARMA).....	10

2.9. Model Autoregressive Integrated Moving Average (ARIMA)	11
2.10. Uji Lagrange-Multiplier	11
2.11. Keruncingan Data (Kurtosis).....	12
BAB III	13
GARCH STUDENT-T.....	13
3.1 Model ARCH.....	13
3.2 Model GARCH.....	14
3.3 Distribusi <i>Student-t</i>	15
BAB IV	17
HASIL DAN PEMBAHASAN	17
4.1 Data Penelitian.....	17
4.2 Uji Kestasioneran Data.....	18
4.3 Pembentukan Model ARMA.....	19
4.4 Pengujian Normalitas Kurtosis.....	22
4.5 Pemodelan GARCH Berdistribusi Student-t	23
4.6 Estimasi IHSG dengan Model GARCH berdistribusi <i>Student-t</i>	26
BAB V	27
KESIMPULAN	27
DAFTAR PUSTAKA.....	28
LAMPIRAN	30