

DAFTAR TABEL

Tabel 4. 1 Statistik Deskriptif	17
Tabel 4. 2 Hasil Uji Stasioneritas.....	19
Tabel 4. 3 Estimasi Model ARMA	20
Tabel 4. 4 Estimasi Parameter Model	21
Tabel 4. 5 Uji ARCH-LM	22
Tabel 4. 6 Uji Residual Kurtosis	23
Tabel 4. 7 Uji Signifikan Parameter GARCH <i>Student-t</i>	24
Tabel 4. 8 Uji ARCH-LM	26

DAFTAR GAMBAR

Gambar 1. 1 <i>Flowchart</i> Penelitian	6
Gambar 3. 1 Fungsi Distribusi <i>Student-t</i>	15
Gambar 4. 1 Grafik Return IHSG	17
Gambar 4. 2 Hasil Transformasi Johnson	18
Gambar 4. 3 Correlogram Uji Stasioner	19
Gambar 4. 4 Plot ACF dan PACF Return IHSG.....	20
Gambar 4. 5 Hasil Uji Q-Ljung Box Model ARMA (2,2).....	21
Gambar 4. 6 Plot ACF dan PACF Residual Kuadrat	23
Gambar 4. 7 Hasil Uji Q-Ljung Box.....	25
Gambar 4. 8 Grafik Perbandingan Data Aktual dan Estiamsi	26

DAFTAR SIMBOL

n	: banyaknya pengamatan
R_t	: nilai <i>return</i> IHSG pada waktu ke- t
Y_t	: nilai variabel pada waktu ke- t
p	: ordo <i>Autoregressive</i> (AR)
q	: ordo <i>Moving Average</i> (MA)
ϕ_i	: parameter AR ($i = 1, 2, \dots, p$)
θ_j	: parameter MA ($j = 1, 2, \dots, q$)
e_t	: nilai <i>error</i> pada waktu ke- t
σ_t^2	: varians residual pada waktu ke- t
ω	: konstanta AR, MA, ARCH dan GARCH
u	: ordo ARCH
v	: ordo GARCH
α_i	: parameter ARCH untuk $i = 1, 2, \dots, u$
β_j	: parameter GARCH untuk $j = 1, 2, \dots, v$
d	: derajat kebebasan
Z_U	: transformasi johnson
b_2	: kurtosis