

DAFTAR ISI

LEMBAR PENGESAHAN	iii
LEMBAR PERNYATAAN	iv
ABSTRAK	v
ABSTRACT	vi
KATA PENGANTAR	vii
UCAPAN TERIMA KASIH	viii
DAFTAR ISI	ix
DAFTAR GAMBAR	xi
DAFTAR TABEL	xii
DAFTAR LAMPIRAN	xiii
BAB I PENDAHULUAN	1
1.1. Latar Belakang	1
1.2. Rumusan Masalah	4
1.3. Tujuan Penelitian	4
1.4. Manfaat Penelitian.....	5
BAB II KAJIAN PUSTAKA	6
2.1. Kajian Penelitian	6
2.2. Landasan Teori.....	15
2.2.1. Saham	15
2.2.2. PT Unilever Indonesia.....	16
2.2.3. Peramalan	17
2.2.4. Volatilitas.....	18
2.2.5. Analisis Deret Waktu	19
2.2.6. Stasioneritas	19
2.2.7. <i>Autoregressive Integrated Moving Average (ARIMA)</i>	21
2.2.8. ARCH-GARCH	23
2.2.9. Filter Kalman	26
2.2.10. Kriteria Pemilihan Model Terbaik	28

BAB III METODOLOGI PENELITIAN	30
3.1 Subjek dan Objek Penelitian	30
3.2 Alat dan Bahan Penelitian	30
3.2.1 Perangkat Keras (<i>Hardware</i>).....	30
3.2.2 Perangkat Lunak (<i>Software</i>).....	30
3.2.3 Bahan/Data.....	30
3.3 Diagram Alir Penelitian	31
3.3.1 Identifikasi Masalah	31
3.3.2 Studi Literatur	32
3.3.3 Pengumpulan Data.....	32
3.3.4 <i>Exploratory Data Analysis</i> (EDA)	32
3.3.5 <i>Preprocessing Data</i>	33
3.3.6 Pemodelan Prakiraan	33
3.3.7 Evaluasi.....	38
3.3.8 Analisis Hasil	38
BAB IV HASIL DAN PEMBAHASAN.....	39
4.1. <i>Exploratory Data Analysis</i> (EDA).....	39
4.2. <i>Data Preprocessing</i>	41
4.3. Pemodelan dan Evaluasi Hasil.....	42
4.3.1 ARCH-GARCH.....	43
4.3.1.1 Uji Stasioneritas Data	43
4.3.1.2 Penentuan Model ARIMA	45
4.3.1.3 Mengidentifikasi Keberadaan Heteroskedastisitas	48
4.3.1.4 Pemodelan ARCH-GARCH.....	52
4.3.2 ARCH-GARCH dengan Penerapan Filter Kalman	58
4.4. Analisis Hasil dan Peramalan	61
BAB V KESIMPULAN DAN SARAN.....	67
5.1 Kesimpulan	67
5.2 Saran.....	67
DAFTAR PUSTAKA.....	68
LAMPIRAN	77