DAFTAR ISI

	Halaman
Lembar Pengesahan	***i***
Riwayat Hidup	***ii***
Abstrak	***iii***
Kata Pengantar	***iv***
Daftar Isi	***vi***
Daftar Gambar	***ix***
Daftar Tabel	***x***
Daftar Lampiran	***xi***
BAB I PENDAHULUAN	
1.1 Latar Belakang	1
1.2 Rumusan Masalah	4
1.3 Batasan Masalah	4
1.4 Tujuan Penelitian	5
1.5 Manfaat Penelitian	5
BAB II LANDASAN TEORI	
2.1 Indeks Harga Saham Gabungan	6
2.2 Stationeritas	7
2.2.1 Uji Kestationeritas Data	9
2.3 Heteroskedastisitas	11
2.3.1 Uji Heteroskedastisitas	12
2.4 Model Umum Deret Waktu	13
2.4.1 Model *Autoregressive* (AR)	13
2.4.2 Model *Moving Average* (MA)	14
2.4.3 Model *Autoregressive Moving Average* (ARMA)	15
2.4.4 Model *Autoregressive Integrated Moving Average* (ARIMA)	15
2.5 Uji Pemilihan Model Terbaik	16

2.5.1 Uji *Akaike Information Criterion (AIC)* 16
2.5.2 Uji *Schwarz Information Criterion (SIC)* 17
2.5.3 Uji Kelayakan Model 17
2.6 *General Autoregressive Conditional Heteroscedasticity (GARCH)* 18
2.6 Analisis *GARCH* Menggunakan *Eviews* 20
2.8 Jaringan Syaraf Tiruan 24
2.8.1 Arsitektur Jaringan 25
2.8.2 Fungsi Aktivasi 27
2.8.3 Algoritma Belajar dan Pelatihan 28
2.8.4 *Backpropagation* 28
2.8.5 Momentum 31
2.8.6 Aplikasi *Backpropagation* dalam Peramalan 32
2.9 *Neuro-GARCH* 34
2.10 Uji Keakuratan Hasil Peramalan 34

BAB III METODE PENELITIAN
3.1 Tempat dan Waktu Penelitian 36
3.2 Jenis Penelitian 36
3.3 Instrumen Pengumpulan Data 36
3.4 Prosedur Penelitian 36

BAB IV PEMBAHASAN
4.1 Pengumpulan Data 40
4.2 Analisis Data dengan Menggunakan Model *GARCH* 40
4.2.1 Identifikasi Kestasioneran Data 40
4.2.2 Pembentukan Model Awal 45
4.2.3 Pengujian Heteroskedastisitas 46
4.2.4 Estimasi Parameter Model *GARCH* 46
4.2.5 Uji Kelayakan Model 47
4.2.6 Peramalan dengan Model *GARCH* 47
4.3 Analisis Data dengan Menggunakan Model *Neuro GARCH* 48

4.3.1 Perancangan Model Peramalan 48
4.3.2 Pemilihan Arsitektur Jaringan Optimum 49
4.3.3 Peramalan dengan Menggunakan Model *Neuro GARCH* 50
4.4 Perbandingan Hasil Peramalan Model *GARCH* dengan *Neuro GARCH* 55

BAB V KESIMPULAN DAN SARAN
5.1 Kesimpulan 57
5.2 Saran 57

DAFTAR PUSTAKA 58

UNIVERSITAS NEGERI MEDAN
UNIMED
THE Character Building UNIVERSITY