

## DAFTAR ISI

<b>ABSTRAK</b> .....	i
<b>KATA PENGANTAR</b> .....	iii
<b>DAFTAR ISI</b> .....	vi
<b>DAFTAR TABEL</b> .....	x
<b>DAFTAR GAMBAR</b> .....	xi
<b>BAB I PENDAHULUAN</b>	
1.1 Latar Belakang .....	1
1.2 Identifikasi Masalah .....	10
1.3 Pembatasan Masalah .....	10
1.4 Perumusan Masalah.....	11
1.5 Tujuan Penelitian.....	11
1.6 Manfaat Penelitian .....	11
<b>BAB II KAJIAN PUSTAKA</b>	
2.1 KerangkaTeoritis .....	13
2.1.1 Metode Analisis Pergerakan Saham .....	13
2.1.1.1 Pergerakan Saham .....	13
2.1.1.2 Analisis Teknikal .....	15
2.1.1.2.1 Pengertian Analisi Teknikal.....	15
2.1.1.2.2 Asumsi Analisis Teknik.....	16
2.1.1.2.3 Penggunaan Grafik sebagai Alat Analisis.	17
2.1.1.2.4 Jenis-jenis Grafik .....	19
2.1.1.2.5 Pola Grafik dalam Analisis Teknikal .....	20
2.1.1.2.6 Analisis Keadaan Pasar .....	21
2.1.1.2.7 Manfaat AnalisisTeknikal.....	22

2.1.2 Metode ARIMA .....	24
2.1.3 Metode GARCH .....	29
2.2 Penelitian Relevan .....	32
2.3 Kerangka Berfikir .....	33

### **BAB III METODE PENELITIAN**

3.1 Lokasi Penelitian .....	36
3.2 Populasi dan Sampel Penelitian .....	33
3.2.1 Populasi .....	36
3.2.2 Sampel .....	36
3.3 Variabel Penelitian dan Defenisi Operasional .....	36
3.3.1 Variabel Penelitian .....	36
3.3.2 Defenisi Operasional .....	37
3.4 Teknik Pengumpulan Data .....	38
3.5 Teknik Analisis Data .....	39
3.5.1 Uji Stasioner .....	39
3.5.2 Uji <i>differencing</i> .....	39
3.6 Pembentukan Model ARIMA .....	40
3.6.1 Pembentukan Model ARIMA (p,d dan q) .....	40
3.6.2 Estimasi Parameter Model ARIMA .....	41
3.6.3 Peramalan ARIMA .....	41
3.6.4 Pengukuran Kesalahan Peramalan ARIMA .....	42
3.7 Pembentukan Model GARCH .....	43
3.7.1 Identifikasi Efek GARCH .....	43
3.7.2 Estimasi Model GARCH .....	43

3.7.3 Evaluasi Model GARCH .....	44
3.7.4 Peramalan .....	44
3.7.5 Pengukuran Kesalahan Peramalan GARCH .....	44

#### **BAB IV HASIL PENELITIAN DAN PEMBAHASAN**

4.1 Hasil Penelitian .....	45
4.1.1 Analisis Data .....	45
4.1.2 Peramalan dengan Metode ARIMA .....	49
4.1.2.1 Penentuan Nilai p, d dan q dalam ARIMA.....	49
4.1.2.2 Estimasi Parameter Model ARIMA .....	50
4.1.2.3 Peramalan .....	51
4.1.2.4 Pengukuran Kesalahan Peramalan ARIMA .....	52
4.1.3 Peramalan dengan Metode GARCH .....	54
4.1.3.1 Identifikasi Efek ARCH .....	54
4.1.3.2 Estimasi Model .....	55
4.1.3.3 Evaluasi Model .....	57
4.1.3.4 Peramalan .....	58
4.1.3.5 Pengukuran Kesalahan .....	58
4.2 Pembahasan .....	60
4.2.1 Keakuratan metode ARIMA dalam memprediksi harga s- aham perusahaan Intiland Development Tbk .....	60
4.2.2 Keakuratan metode GARCH dalam memprediksi harga s- aham perusahaan Intiland Development Tbk .....	61
4.2.3 Perbandingan keakuratan antara metode ARIMA dan GAR- CH dalam memprediksi harga saham perusahaan Intiland – Development Tbk .....	63

**BAB V KESIMPULAN DAN SARAN**

5.1 Kesimpulan .....	65
5.2 Saran .....	66

**DAFTAR PUSTAKA**

**LAMPIRAN**

