

DAFTAR ISI

	<i>Hal</i>
Lembar Motto dan Persembahan	<i>i</i>
Lembar Pengesahan	<i>ii</i>
Lembar Pernyataan Original	<i>iii</i>
Lembar Persetujuan Publikasi	<i>iv</i>
Riwayat Hidup	<i>v</i>
Abstrak	<i>vi</i>
Abstract	<i>vii</i>
Kata Pengantar	<i>viii</i>
Daftar Isi	<i>x</i>
Daftar Tabel	<i>xii</i>
Daftar Gambar	<i>xiii</i>
Daftar Lampiran	<i>xiv</i>
BAB I PENDAHULUAN	1
1.1 Latar Belakang	1
1.2 Rumusan Masalah	4
1.3 Batasan Masalah	4
1.4 Tujuan Penelitian	4
1.5 Manfaat Penelitian	5
BAB II TINJAUAN TEORI	6
2.1 Emas	6
2.2 Keunggulan Investasi Emas	7
2.3 Faktor-Faktor Yang Mempengaruhi Harga Emas	8
2.3.1 Faktor Fundamental	8
2.3.2 Faktor Sekunder	9
2.4 Peramalan (<i>Forecasting</i>)	10
2.5 Analisis Deret Waktu (<i>Time Series</i>)	10
2.6 Uji Stasioneritas Data	11

2.7	Differencing Data	13
2.8	Uji Autokorelasi	14
2.9	Arima Box-Jenkins	19
2.10	Metode ARCH-GARCH.....	22
2.11	Estimasi Parameter	26
2.12	Uji <i>Akaike Information Criterion</i> (AIC) dan <i>Schwarz's Information Criterion</i> (SIC).....	28
2.13	ARCH-LM	28
2.14	Penerapan Model Untuk Peramalan	29
2.15	Menghitung Kesalahan Peramalan	29
2.16	Tahapan Metode Pengolahan Data	30
BAB III	METODE PENELITIAN.....	32
3.1	Tempat Dan Waktu Penelitian	32
3.2	Jenis Penelitian	32
3.3	Prosedur Penelitian	32
BAB IV	HASIL DAN PEMBAHASAN	35
4.1	Deskripsi Data	35
4.2	Uji Kestasioneran	36
4.3	Pemodelan ARIMA	37
4.4	Uji Heterokedastisitas	38
4.5	Estimasi Parameter Model ARCH-GARCH.....	39
4.6	ARCH-LM	39
4.7	Peramalan.....	40
4.4	Ketepatan Model Peramalan	41
BAB V	PENUTUP.....	42
5.1	Kesimpulan	42
5.2	Saran	42
	Daftar Pustaka	43

DAFTAR TABEL

	<i>Hal</i>
Tabel 2.1 Identifikasi p dan q melalui nilai ACF dan PACF	17
Tabel 2.2 Kriteria Nilai <i>Mean Absolute Percentage Error</i> (MAPE)	27
Tabel 4.1 Uji Akar (<i>Unit Root Test</i>) dengan metode <i>Augmented Dickey Fuller Test</i>	33
Tabel 4.2 <i>Differencing</i> Uji Akar (<i>Unit Root Test</i>) dengan metode <i>Augmented Dickey Fuller Test</i>	33
Tabel 4.3 Hasil Estimasi Model ARIMA	35
Tabel 4.4 Uji Heterokedastisitas	36
Tabel 4.5 Uji ARCH-LM	36
Tabel 4.6 Tabel Peramalan Harga Emas	37
Tabel 4.6 Ketepatan Model Peramalan	38

UNIMED
THE
Character Building
UNIVERSITY

DAFTAR GAMBAR

	<i>Hal</i>
Gambar 2.1 Nilai ACF dan PACF Teoritis untuk Model AR(1).....	17
Gambar 2.2 Nilai ACF dan PACF Teoritis untuk Model MA(1).....	18
Gambar 3.1 Flowchart.....	31
Gambar 4.1 Plot data <i>time series</i> harga emas.....	32
Gambar 4.1 Grafik Peramalan Harga Emas	37



THE
Character Building
UNIVERSITY

DAFTAR LAMPIRAN

	<i>Hal</i>
Lampiran 1 Tabel Harga Emas	42
Lampiran 2 Grafik.....	46
Lampiran 3 Correlogram.....	47
Lampiran 4 Model Tentatif ARIMA.....	50
Lampiran 5 Model Tentatif GARCH.....	55
Lampiran 6 Hasil Peramalan.....	57
Lampiran 7	00
Lampiran 8	00
Lampiran 9	00
Lampiran 10	00

UNIVERSITAS NEGERI MEDAN
UNIMED

THE
Character Building
UNIVERSITY