UNIVERSITAS
GADJAH MADA
MODEL RUNTUN WAKTU POWER AUTOREGRESSIVE CONDITIONAL HETEROSCEDASTICITY (PARCH)
Gayuh Priyo Pambudi, Prof. Drs. H. Subanar, Ph.D
Universitas Gadjah Mada, 2009 | Diunduh dari http://etd.repository.ugm.ac.id/

INTISARI

Model Runtun Waktu *Power Autoregressive Conditional Heteroscedasticity* (PARCH)

Oleh :
GAYUH PRIYO PAMBUDI
04 / 178222 / PA / 10178

Tugas akhir ini membahas tentang model Power Autoregressive Conditional Heteroscedasticity (PARCH). Model ini diperkenalkan oleh Ding, Granger, dan Engle (1993). PARCH model merupakan sebuah kelas baru dari jenis ARCH yang mengoptimalkan power term dalam model. Studi kasus mengenai harga saham General Motors Corporation diangkat sebagai aplikasi dari model PARCH dan akan dicari pemodelan terbaiknya.

Kata Kunci :Time Series, Volatility, Power-ARCH.

UNIVERSITAS
GADJAH MADA
MODEL RUNTUN WAKTU POWER AUTOREGRESSIVE CONDITIONAL HETEROSCEDASTICITY (PARCH)
Gayuh Priyo Pambudi, Prof. Drs. H. Subanar, Ph.D
Universitas Gadjah Mada, 2009 | Diunduh dari http://etd.repository.ugm.ac.id/

ABSTRACT

***Power Autoregressive Conditional Heteroscedasticity* (PARCH)**
Time Series Model

By :
GAYUH PRIYO PAMBUDI
04 / 178222 / PA / 10178

This paper explain about Power Autoregressive Conditional Heteroscedasticity (PARCH) model. This model introduced by Ding, Granger, dan Engle (1993). PARCH model is a new class of ARCH model which the optimal power term within the model. Case Study concerning stock of General Motors Corporation as application from PARCH model and then to seek the best model.

Key Words : Time Series, Volatility, Power-ARCH.