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/

DAFTAR ISI

Halaman Judul…..…….. i
Halaman Pengesahan..... ii
Halaman Persembahan..... iii
Prakata.....……..... iv
Daftar Isi…….....……..... v
Daftar Tabel…….....……... vii
Daftar Gambar…….....…….. viii
Daftar Lampiran…….....……... ix
Intisari…….....……... x
Abstract..... xi

BAB I. Pendahuluan……..…….
1.1. Latar Belakang Masalah ……..…… 1
1.2. Maksud dan Tujuan Penulisan …… 2
1.3. Metode Penulisan ……..……..…… 3
1.4. Perumusan dan Pembatasan Masalah…….…. 3
1.5. Sistematika Penulisan.....……. 3

BAB II. Dasar Teori …….....……
2.1. Autocorrelation Function dan Partial Autocorrelation Function ... 5
2.1.1. Autocorrelation Function 5
2.1.2. Partial Autocorrelation Function 6
2.2. Stasioner dan Nonstasioner..... 8
2.3. Pembedaan (differencing)..... 9
2.4. Model-Model Runtun Waktu yang Stasioner..... 9
2.4.1. Model Autoregressive (AR)..... 9
2.4.2. Model Moving Average (MA)..... 10
2.4.3. Model Autoregressive Moving Average (ARMA)..... 11
2.5. Model ARCH..... 12
2.5.1. Bentuk Umum……..…… 12
2.5.2. Pengujian Efek ARCH dalam Model…… 13
2.6. Model GARCH..... 14
2.7. Estimasi Model..... 14
2.8. Pemeriksaan Diagnostik……... 15
2.9. *Akaike's Information Criterion* (AIC)..……... 15
3.0. *Bayesian Information Criterion (*BIC).....……... 16
3.1. *R-squared*…… 16

BAB III. Model Power *Autiregressive Conditional Heteroscedasticity*……..
3.1. Pendahuluan…… …… 17
3.2. Proses PARCH (1,1)..... 18
3.3. Proses PARCH (p,q)..... 19
3.4. Identifikasi Model..... 19
3.5. Estimasi Parameter..... 20

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/

BAB IV. Studi Kasus .....
4.1. Stasioneritas..... 26
4.2. Pembentukan Model Mean..... 28
4.3. Pengujian Adanya Efek ARCH..... 29
4.4. Estimasi Model PARCH..... 30
4.5. Perbandingan dengan Model lain..... 33

BAB V. Penutup .....
5.1. Kesimpulan 36
5.2. Saran 36

Daftar Pustaka 37

Lampiran 39