

DAFTAR ISI

	Halaman
HALAMAN JUDUL.....	i
HALAMAN PERSETUJUAN.....	ii
LEMBAR PERNYATAAN.....	iii
KATA PENGANTAR.....	iv
DAFTAR ISI.....	vi
DAFTAR TABEL.....	viii
DAFTAR GRAFIK	ix
DAFTAR LAMPIRAN.....	x
ABSTRAC.....	xi
INTISARI	xii
BAB I PENDAHULUAN	1
1.1 Latar Belakang Permasalahan.	1
1.2 Rumusan Masalah.	3
1.3 Tujuan Penelitian	4
1.4 Kegunaan Penelitian.	4
1.5 Lingkup Penelitian	5
1.6 Sistematika Pembahasan	7
BAB II TINJAUAN PUSTAKA	9
2.1 Investasi dan Pasar Modal	9
2.1.1 Peranan Pasar Modal	9
2.1.2 Investasi di Pasar Modal	10
2.1.3 Bentuk Efisiensi Pasar Modal	11
2.1.4 Anomali Pasar	13
2.1.5 Weekend Effect	16
2.1.6 Analisis Teknikal	18
2.1.7 Indeks LQ45	20
2.2 Beberapa Konsep Runtun Waktu	22
2.2.1 Definisi Runtun Waktu	22
2.2.2 Stasioneritas	22
2.2.3 Diferensi	24
2.2.4 Fungsi Autokorelasi	25
2.2.5 Fungsi Autokorelasi Parsial	25
2.2.6 White Noise (Purely Random Process)	26
2.2.7 Model Regresi Linier dengan Variabel Dummy	27
2.2.8 Model ARMA	28
2.2.8.1 Model Autoregresif (AR)	28
2.2.8.2 Model Rata-rata Bergerak (MA)	29

2.2.8.3 Model Autoregressive Moving Avarage (ARMA)	30
2.2.8.4 Model ARIMA	31
2.2.9 Model ARCH dan GARCH	32
2.2.9.1 Model ARCH	33
2.2.9.2 Model GARCH (p,q)	33
2.2.9.3 Model GARCH (1,1)	34
2.2.9.4 Model Estimasi Model ARCH	
BAB III METODE PENELITIAN	38
3.1 Pengumpulan Data	38
3.2 Uji Anova dan Uji PostHoc	38
3.3 Pemodelan Autoregressive Moving Average (ARMA) & GARCH	41
3.3.1 Uji Stasioneritas	42
3.3.2 Uji Signifikansi Parameter Persamaan Conditional Mean.	43
3.3.3 Uji Heteroscedastis	45
3.3.3.1 Uji Stasioneritas	42
3.3.3.2 Uji Durbin-Watson	46
3.3.3.3 Uji Langrange Multiplier (LM)	47
3.3.4 Pemodelan Conditional Variance	48
3.3.5 Analisis Nilai Adjusted R-Squared, AIC dan Schwarz Criterion	48
3.3.6 Diagram Alur Pembentukan Model Optimal	50
BAB IV ANALISIS DAN TEMUAN	52
4.1 Analisis awal dan temuan Data Return periode 2003-2007	52
4.1.1 Statistik Deskriptif	52
4.1.2 Uji Anova	54
4.1.3 Uji PostHoc	54
4.2 Analisis Pemodelan Autoregressive Moving Avarage	
4.2.1 Uji Stasioner	55
4.2.2 Uji Correlogram Level	56
4.2.3 Pendugaan Model	57
4.2.4 Pemilihan Model	58
4.2.5 Pengujian Asumsi residual tidak terjadi autokorelasi dan Kemohogenan ragam Residual	58
4.3 Analisis Pemodelan Conditional Mean & Conditional Variance, GARCH	60
4.3.1 Pemilihan Model	60
4.3.2 Pengujian Asumsi residual tidak terjadi autokorelasi	61
BAB V Kesimpulan dan Saran	63
5.1 Kesimpulan	63
5.2 Saran	64
DAFTAR PUSTAKA	67