

	No. Alumni Universitas	Annisa Primadini	No. Alumni Fakultas
	BIODATA		
<p>a) Tempat/Tanggal Lahir: Bukittinggi/ 24 Maret 1994 b) Nama Orang Tua: Amran dan Dewi Mulyani c) Fakultas: Ekonomi d) Jurusan: Manajemen e) No. BP :1210522009 f) Tanggal Lulus: 1 April 2016 g) Predikat Lulus: Dengan Pujian h) IPK: 3,63 i) Lama Studi : 3 tahun 8 bulan j) Alamat Orang Tua: Jln. Kamboja RT.001 RW.001 , Kel.Subarang Batuang, Kec. Payakumbuh Barat, Kota Payakumbuh</p>			
ABSTRAK			
Prediksi Indeks Harga Saham Gabungan (IHSG) Menggunakan Metode Arch-GARCH dan Metode ARIMA			
<p>Penelitian melakukan prediksi nilai Indeks Harga Saham Gabungan (IHSG) untuk periode 2 Januari 2015 menggunakan dua metode yaitu metode Arch-GARCH dan Metode ARIMA. Perbedaan dari kedua metode ini adalah terletak pada variabel yang digunakan dan kriteria data. Data yang digunakan pada penelitian ini memiliki periode dari 1 Januari 2014 hingga 31 Desember 2014. Metode Arch-GARCH dalam memprediksi menggunakan <i>panel data</i> karena IHSG sebagai variabel dependen, dan empat variabel independen yaitu DJIA (Dow Jones Industrial Averages), NASDAQ, NIKKEI dan KURS Rupiah terhadap Dolar. Metode ARIMA menggunakan <i>time series</i> data karena hanya satu variabel IHSG yang akan diolah untuk melakukan prediksi. Melakukan prediksi menggunakan metode Arch GARCH mengharuskan residual data bersifat heteroskedastisitas, terdapatnya <i>volatility clustering</i> dan <i>arch effect</i>. Berbeda dengan Metode ARIMA yang mengharuskan data bersifat stasioner. Pengolahan dan pengujian data dilakukan menggunakan STATA 12. Hasil analisis menemukan model yang cocok untuk prediksi IHSG adalah model Arch-GARCH (1,1) GED (3) dan model ARIMA (0,1,0). Hasil perbandingan menunjukkan bahwa model ARIMA (0,1,0) lebih superior dibandingkan model Arch-GARCH (1,1) GED (3).</p>			
Kata Kunci: IHSG, metode ARCH-GARCH, metode ARIMA.			

Skripsi ini dipertahankan di depan sidang pengujian dan dinyatakan lulus pada tanggal 1 April 2016. Abstrak ini telah disetujui oleh pembimbing dan penguji:

TandaTangan			
Nama Terang	Venny Darlis, SE, MRM	Sari Surya, SE, MM	Idamiharti, SE, M.Sc

Mengetahui:
Ketua Jurusan

Dr. Vera Pujani, SE, MM, Tech
NIP. 19661115 200003 2 001

TandaTangan

Alumnus telah mendaftar ke Fakultas/Universitas dan mendapat nomor alumnus:

	Petugas Fakultas/Universitas	
No. Alumni Fakultas:	Nama	TandaTangan
No. Alumni Universitas	Nama	TandaTangan