

DAFTAR GAMBAR

Gambar 3. 1 Diagram Alir Penelitian	31
Gambar 4. 1 Boxplot Variabel Close	40
Gambar 4. 2 Plot Time Series Variabel Close	42
Gambar 4. 3 Plot ACF (Atas) dan PACF (Bawah) Variabel Close	44
Gambar 4. 4 Plot Hasil Transformasi Logaritma (Atas) dan Plot Hasil Transformasi Logaritma dan Differencing 1 Kali (Bawah)	44
Gambar 4. 5 Plot Plot ACF (Kiri) dan PACF (Kanan) Hasil Transformasi Logaritma dan Differencing 1	45
Gambar 4. 6 Hasil EACF Data Transformasi Logaritma dan Differencing 1	46
Gambar 4. 7 QQ-Plot Residual Model ARIMA(2,1,3)	49
Gambar 4. 8 Plot Uji Ljung-Box Residual Model ARIMA(2,1,3)	50
Gambar 4. 9 Plot ACF Residual Model ARIMA(2,1,3)	51
Gambar 4. 10 Plot ACF (Kiri) dan PACF (Kanan) Residual GARCH(1,2)-sstd....	56
Gambar 4. 11 Perbandingan Harga Aktual dan Prediksi GARCH(1,2)-sstd	57
Gambar 4. 12 Perbandingan Harga Aktual dan Prediksi GARCH(1,2)-sstd dengan Filter Kalman	61
Gambar 4. 13 Perbandingan Harga Aktual dan Prediksi GARCH(1,2) dan GARCH(1,2) dengan Filter Kalman	61
Gambar 4. 14 Visualisasi Validasi Harga Saham PT Unilever Indonesia dengan GARCH(1,2) dengan Filter Kalman	65
Gambar 4. 15 Zoom Prediksi 1 bulan Harga Saham PT Unilever Indonesia dengan GARCH(1,2) dengan Filter Kalman	66