

DAFTAR TABEL

Tabel 1.1 Daftar Saham LQ45 Sektor Energi Periode Februari - April 2025.....	6
Tabel 2. 1 Penelitian Terdahulu	32
Tabel 3. 1 Karakteristik Penelitian.....	43
Tabel 3. 2 Variabel Operasional.....	44
Tabel 3. 3 Kriteria Sampel	47
Tabel 4. 1 Harga Penutupan Harian Tujuh Emiten Saham Energi	56
Tabel 4. 2 Data Return Tujuh Emiten Saham Energi.....	62
Tabel 4. 3 Statistik Deskriptif	62
Tabel 4. 4 Hasil Pengujian Stasioneritas Data Return Saham	67
Tabel 4. 5 Perbandingan Model ARIMA pada Return Saham ADMR	69
Tabel 4. 6 Perbandingan Model ARIMA pada Return Saham ADRO	71
Tabel 4. 7 Perbandingan Model ARIMA pada Return Saham AKRA	74
Tabel 4. 8 Perbandingan Model ARIMA pada Return Saham ITMG	77
Tabel 4. 9 Perbandingan Model ARIMA pada Return Saham MEDC	79
Tabel 4. 10 Perbandingan Model ARIMA pada Return Saham PGAS	82
Tabel 4. 11 Perbandingan Model ARIMA pada Return Saham PTBA	84
Tabel 4. 12 Hasil Pengujian Heteroskedastisitas Residual ARIMA	86
Tabel 4. 13 Perbandingan Model GARCH pada Return Saham ADMR.....	87
Tabel 4. 14 Perbandingan Model GARCH pada Return Saham ADRO	89
Tabel 4. 15 Perbandingan Model GARCH pada Return Saham AKRA	91
Tabel 4. 16 Perbandingan Model GARCH pada Return Saham ITMG.....	93
Tabel 4. 17 Perbandingan Model GARCH pada Return Saham PTBA.....	95
Tabel 4. 18 Hasil Pengujian Heteroskedastisitas Residual GARCH	101
Tabel 4. 19 Peramalan Volatilitas Return Saham ADMR Periode 16 Hari Berikutnya.....	102
Tabel 4. 20 Peramalan Volatilitas Return Saham ADRO Periode 16 Hari Berikutnya.....	103
Tabel 4. 21 Peramalan Volatilitas Return Saham AKRA Periode 16 Hari Berikutnya.....	105

Tabel 4. 22 Peramalan Volatilitas Return Saham ITMG Periode 16 Hari Berikutnya	106
Tabel 4. 23 Peramalan Volatilitas Return Saham PTBA Periode 16 Hari Berikutnya	107