

ABSTRAK

Model ARCH (*Autoregressive Conditional Heteroscedastic*) merupakan model autoregresif dalam keadaan variansi tidak konstan. Model ini akan digunakan untuk menentukan, meramalkan dan memperbaharui nilai parameter dari data runtun waktu yang variansinya tidak konstan. Nilai parameter dari model ARCH dapat diperoleh dengan menggunakan metode maksimum likelihood.



ABSTRACT

ARCH (*Autoregressive Conditional Heteroscedastic*) model is inconstant variance autoregressive model. Variance is a variable in statistic that illustrate how far the changes of the data to mean. This model will be used to fit, to forecast, and to update renew parameter from inconstant variance of time series data. ARCH model parameter value can be obtained by using likelihood maximum method.

