

**STUDI TENTANG KETEPATAN UJI NISBAH RAGAM OLEH
LO DAN MACKINLAY**

Skripsi Sarjana Matematika

Oleh

MEGA MASRI YANCE

01134009



**JURUSAN MATEMATIKA
FAKULTAS MATEMATIKA DAN ILMU PENGETAHUAN ALAM
UNIVERSITAS ANDALAS
PADANG**

2006

ABSTRAK

Pada penelitian ini akan dibangkitkan bilangan acak dengan dua bentuk tipe data, yaitu data yang bersifat homoskedastisitas dan data yang bersifat heteroskedastisitas. Pada masing-masing data dilakukan uji homoskedastisitas dan uji heteroskedastisitas yang diusulkan oleh Lo dan Mackinlay (1988). Diharapkan data yang bersifat homoskedastisitas dapat dideteksi oleh uji homoskedastisitas dan data yang bersifat heteroskedastisitas dapat dideteksi oleh uji heteroskedastisitas. Penelitian dilakukan dengan simulasi Monte Carlo. Hasil simulasi untuk jumlah data ukuran kecil berbeda dengan jumlah data ukuran besar. Uji homoskedastisitas dan uji heteroskedastisitas tidak bisa mendeteksi sifat homoskedastisitas dan heteroskedastisitas yang ada pada data.

Kata Kunci : *uji homoskedastisitas, uji heteroskedastisitas, data yang bersifat homoskedastisitas, data yang bersifat heteroskedastisitas dan simulasi Monte Carlo.*

1.3 Pembatasan Masalah

Dalam penelitian ini akan dilihat ketepatan dari uji homoskedastisitas dan uji heteroskedastisitas pada uji nisbah ragam yang diusulkan oleh Lo dan Mackinlay. Penelitian ini menggunakan data yang bersifat homoskedastisitas dan heteroskedastisitas dengan cara membangkitkan data secara acak pada proses simulasi.

1.4 Tujuan Penulisan

Tujuan penelitian ini adalah untuk memeriksa ketepatan uji kehomogenan dan uji keheterogenan ragam yang di temukan oleh Lo dan Mackinlay pada tahun 1988.

1.5 Sistematika Penulisan

Penulisan skripsi ini terdiri dari

- BAB I : Pendahuluan. Bab ini berisi latarbelakang, perumusan masalah, tujuan penulisan dan sistematika penulisan
- BAB II : Landasan Teori. Bab ini berisi tentang teori-teori yang mendukung pembahasan masalah.
- BAB III : Metodologi Penelitian. Bab ini berisi tentang metode yang digunakan.
- BAB IV : Pembahasan. Bab ini berisi hasil pengolahan dan pembahasan terhadap hasil yang diperoleh.
- BAB V : Penutup. Bab ini berisi kesimpulan dan saran.

BAB V

KESIMPULAN DAN SARAN

5.1 Kesimpulan

a. Untuk data homoskedastisitas

Berdasarkan simulasi yang ada persentase menolak H_0 untuk uji homoskedastisitas dan uji heteroskedastisitas hampir sama, sehingga dapat dikatakan bahwa uji nisbah ragam yang diusulkan oleh Lo dan Mackinlay pada simulasi ini belum bisa menguji dengan tepat untuk data yang bersifat homoskedastisitas, artinya data yang bersifat homoskedastisitas tidak dapat dideteksi dengan baik oleh uji homoskedastisitas.

b. Untuk data heteroskedastisitas

Setelah dilakukan simulasi ternyata persentase menolak H_0 untuk homoskedastisitas dan uji heteroskedastisitas hampir sama, sehingga dapat dikatakan bahwa uji nisbah ragam yang diusulkan oleh Lo dan Mackinlay khususnya untuk simulasi ini belum dapat menguji dengan tepat untuk data yang bersifat heteroskedastisitas, yang artinya data yang bersifat heteroskedastisitas tidak dapat dideteksi dengan baik oleh uji heteroskedastisitas

5.2 Saran

Karena dalam penelitian hanya dibatasi pada data yang menyebar normal dengan nilai tengah 0 dan simpangan baku 1 dan nilai $q=2$, maka penulis menyarankan untuk penelitian selanjutnya dapat dilakukan dengan

DAFTAR PUSTAKA

- [1] Aman, A. 1997. *Analisis Sistem dan Model Simulasi*. IPB Press, Bogor
- [2] Grieb.T and Rayes.G.Mario.1999. *Random Walk Test For latin American Equity Indexes and Individual Firms*, Journal of Financial Research 4, 371-383.
- [3] Gujarati,N.Damodar.1995. *Basic Econometrics* .Mc Graw-hill, Inc
- [4] Lo.A.W.and A.C.Mackinlay.1988. *Stock Market Do Not Follow Random Walk;Evidence From a Simple Specification Test*, Review of Financial Studies 1.41-46
- [5] Nor.M.F and Manaf.A. *Price Randomness, Fundamental Factors, and Stock Market Contrarian Strategy : Further Evidence on Malaysian Stock Market*.Faculty of Business Management, University Kebangsaan Malaysia
- [6] Susetyo,B.1997. *Pembangkitan Bilangan Acak dalam Simulasi*.IPB Press, Bogor