

Daftar Isi

Lembar Pengesahan	i
Abstrak	ii
<i>Abstract</i>	iii
Lembar Persembahan	iv
Kata Pengantar	vi
Daftar Isi	vii
Daftar Gambar	ix
Daftar Tabel	x
1. Pendahuluan.....	1
1.1. Latar Belakang	1
1.2. Perumusan Masalah.....	2
1.3. Batasan Masalah.....	2
1.4. Tujuan.....	2
1.5. Metodologi Penyelesaian Masalah.....	2
1.6. Sistematika Pembahasan	3
2. Tinjauan Pustaka.....	5
2.1. Return	5
2.2. Volatilitas	6
2.3. Konsep Asimetris	7
2.4. Model Generalized Autoregressive Conditional Heteroscedasticity	8
2.5. Model Stochastic Volatility Autoregressive	9
2.6. Fungsi Likelihood	9
2.7. Kriteria Pemilihan Model Terbaik dan Validasi Model.....	10
3. Perancangan Sistem.....	11
3.1. Deskripsi Sistem.....	11
3.2. Data	11
3.2.1 Statistika Deskriptif	11
3.3. Alur Perancangan Sistem	12
3.3.1 Perancangan Sistem Model GARCH (1,1)	13
3.3.2 Perancangan Sistem Model SVAR (1)	14
4. Implementasi Hasil	15
4.1. Analisis Data	15

4.2.	Model GARCH (1,1).....	16
4.2.1	Fungsi Likelihood Model GARCH (1,1).....	16
4.2.2	Nilai Parameter dari Metode Maksimum Likelihood	17
4.2.3	Analisis Sifat Asimetris atau Leverage Effect pada Model	18
4.3	Model SVAR (1).....	19
4.3.1	Nilai Parameter dari Metode Maksimum Likelihood	20
4.3.2	Analisis Sifat Asimetris atau Leverage Effect pada Model	21
4.4.	Validasi Model	22
4.5.	Eksperimen Dengan Data Lain atau Pembandingan.....	23
5.	Kesimpulan dan Saran	27
5.1.	Kesimpulan.....	27
5.2.	Saran.....	27
	Daftar Pustaka.....	28
	Lampiran	29
L.1.	Definisi Model GARCH (1,1).....	29
L.1.1	Sifat Distribusi Model GARCH (1,1).....	29
L.2.	Definisi Model SVAR (1)	31
L.2.1	Sifat Distribusi Model SVAR(1)	31
	Lampiran A : Kode Matlab Model Volatilitas Data	33
	Lampiran B : Kode Matlab Simulasi Model GARCH (1,1)	33
	Lampiran C : Kode Matlab Simulasi Model SVAR (1)	35