

DAFTAR ISI

LEMBAR PENGESAHAN	ii
LEMBAR PERNYATAAN	iii
LEMBAR PERSEMBAHAN	iv
ABSTRAK	vi
ABSTRACT	vii
KATA PENGANTAR	viii
DAFTAR ISI	ix
DAFTAR TABEL	xi
DAFTAR GAMBAR	xii
1. PENDAHULUAN	1
1.1 LATAR BELAKANG MASALAH	1
1.2 PERUMUSAN MASALAH	1
1.3 BATASAN MASALAH	2
1.4 TUJUAN PENELITIAN	2
1.5 HIPOTESIS	2
1.6 METODOLOGI PENYELESAIAN MASALAH	2
2. LANDASAN TEORI	4
2.1 Return	4
2.2 Maksimum Likelihood Estimations(MLE)	5
2.3 Volatilitas	6
2.4 Validasi Model	7
2.5 Kestasioneran	8
3. ANALISIS PERANCANGAN SISTEM	9
3.1. DESKRIPSI SISTEM	9
3.2. PERANCANGAN SISTEM	9
4. IMPLEMENTASI SISTEM, PENGUJIAN DAN ANALISIS	12
4.1. Analisis Data	12
4.2. Model GARCH (0,1)	12
4.2.1. Sifat Distribusi Model GARCH (0,1)	12
4.2.2. Fungsi Likelihood Model GARCH (0,1)	13

4.2.3. Nilai Parameter dari Model Maksimum Likelihood.....	14
4.2.4. Analisi Sifat Kestasioneran pada Model GARCH (0,1)	14
4.3. Model GARCH (0,2).....	17
4.3.1. Sifat Distribusi Model GARCH (0,2)	17
4.3.2. Fungsi Likelihood Model GARCH (0,2).....	18
4.3.3. Nilai Parameter dari Model Maksimum Likelihood.....	19
4.3.4. Analisis Sifat Kestasioneran pada Model	19
4.4. Validasi Model	22
5. PENUTUP	23
5.1 Kesimpulan.....	23
5.2 Saran.....	23
DAFTAR PUSTAKA	24
LAMPIRAN.....	25
DATA Error! Bookmark not defined.	