

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
BAB I PENDAHULUAN.....	1
1.1 Latar Belakang	1
1.2 Perumusan Masalah.....	1
1.3 Batasan Masalah.....	2
1.4 Tujuan.....	2
1.5 Hipotesa.....	2
1.6 Sistematika Penulisan.....	2
BAB II TINJAUAN PUSTAKA	4
2.1 <i>Return</i>	4
2.2 Volatilitas	4
2.3 Sifat Asimetri	6
2.4 Model ARCH(1).....	6
2.5 Model EGARCH	6
2.6 Validasi Model	7
2.7 Estimasi Maksimum likelihood.....	7
BAB III PERANCANGAN SISTEM	9
3.1 Deskripsi Sistem.....	9
3.2 Data	9
3.3 Perancangan Sistem.....	10
BAB IV HASIL ANALISIS DAN PENGUJIAN	13
4.1 Fungsi Likelihood Model ARCH(1)	13

4.4 Analisis Sifat Asimetris pada Model ARCH.....	14
4.2 Estimasi Parameter	15
4.5 Fungsi Likelihood Model EGARCH.....	16
4.6 Estimasi Parameter	17
4.7 Sifat Asimetris model.....	19
4.8 Validasi Model	20
BAB V KESIMPULAN DAN SARAN	22
5.1 Kesimpulan.....	22
5.2 Saran.....	22
DAFTAR PUSTAKA	23
LAMPIRAN 1: Kode Matlab Model EGARCH.....	24
LAMPIRAN 2: Kode Matlab Model EGARCH.....	26