

Daftar Isi

Lembar Pernyataan.....	ii
Lembar Pengesahan	iii
Abstrak	iv
<i>Abstract</i>	v
Lembar Persembahan	vi
Kata Pengantar	viii
Daftar Isi.....	ix
Daftar Gambar.....	xi
Daftar Tabel	xii
1. Pendahuluan.....	1
1.1 Latar Belakang	1
1.2 Rumusan Masalah.....	2
1.3 Batasan Masalah	2
1.4 Tujuan	2
1.5 Metodologi Penyelesaian Masalah	3
2 Kajian Pustaka	4
2.1 <i>Return Saham</i>	4
2.2 Volatilitas	5
2.3 <i>Generalized Autoregressive Conditional Heteroscedasticity</i>	6
2.4 <i>Artificial Neural Networks</i>	7
2.5 Validasi Model.....	9
2.5.1 <i>Root Mean Squad Error</i>	9
2.5.1 <i>Mean Absolute Error</i>	10
3 Analisis Perancangan Sistem	11
3.1 Data	11
3.2 Alur Perancangan Sistem	12
3.2.1 Alur Perancangan Sistem GARCH(1,1)	12
3.2.2 Alur Perancangan Sistem ANN- GARCH(1,1)	13
4 Analisis Implementasi Hasil	15
4.1 Analisis Data.....	15

4.2	Model GARCH(1,1)	16
4.2.1	Sifat Distribusi Model GARCH(1,1)	16
4.2.2	Fungsi <i>Likelihood</i> Model GARCH(1,1).....	16
4.2.3	Nilai Parameter <i>Likelihood</i> Model GARCH(1,1)	18
4.3	<i>Artificial Neural Networks - Generalized Autoregressive Conditional Heteroscedasticity</i>	19
4.4	Hasil Perhitungan Validasi Model	23
5.	Kesimpulan dan Saran	25
5.1.	Kesimpulan	25
5.2.	Saran	25
	Daftar Pustaka	26
	Lampiran 1 : Tabel Prediksi Volatilitas Menggunakan Model GARCH(1,1)	27
	Lampiran 1 : Tabel Prediksi Volatilitas Menggunakan Model ANN-GARCH(1,1).....	28