

DAFTAR TABEL

Tabel 1.1 Imbal Hasil Harian IHSG 10 Tahun Terakhir.....	3
Tabel 2.1 Daftar Penelitian Sebelumnya.....	29
Tabel 3.1 Karakteristik Penelitian	37
Tabel 3.2 Variabel Operasional	39
Tabel 4.1 Tabel perubahan (<i>return</i>) IHSG.....	44
Tabel 4.2 Standar Deviasi Harian pada tahun 2009-2018	45
Tabel 4.3 Standar Deviasi Tahunan pada tahun 2009-2018	45
Tabel 4.4 Nilai AIC dan SIC masing-masing model.....	49
Tabel 4.5 Model GARCH Terbaik	50
Tabel 4.6 Suku Bunga Bank Indonesia selama periode 2009-2018	51
Tabel 4.7 Nilai Variabel Black Scholes	52
Tabel 4.8 Perhitungan Nilai Distribusi Normal.....	53
Tabel 4.9 Nilai Call dan Put Model Black-Scholes pada 1 April 2009	53
Tabel 4.10 Nilai Variabel Black Scholes dengan Volatilitas GARCH.....	54
Tabel 4.11 Perhitungan Nilai Distribusi Normal.....	54
Tabel 4.12 Nilai Call dan Put dengan Volatilitas GARCH 1 April 2009	55
Tabel 4.13 Perhitungan Untung atau Rugi Strategi <i>Long Strangle</i>	56
Tabel 4.14 Persentase Daerah Untung atau Rugi Strategi <i>Long Strangle</i>	56
Tabel 4.15 Perhitungan AMSE untuk jangka waktu satu bulan.....	57
Tabel 4.16 Perhitungan AMSE jangka waktu satu bulan tiap tahunnya.....	58
Tabel 4.17 Perhitungan AMSE untuk jangka waktu dua bulan	58
Tabel 4.18 Perhitungan AMSE jangka waktu dua bulan tiap tahunnya	59
Tabel 4.19 Perhitungan AMSE untuk jangka waktu tiga bulan	59
Tabel 4.20 Perhitungan AMSE jangka waktu tiga bulan tiap tahunnya	60