

DAFTAR TABEL

Tabel 1.1	Pengembalian Tertinggi dan Terendah LQ45 dalam 5 tahun terakhir	1
Tabel 1.2	Pengembalian Tertinggi dan Terendah LQ45 dalam 19 tahun terakhir	3
Tabel 2.1	Tabel perbandingan penelitian sebelumnya	33
Tabel 3.1	Variabel Penelitian	40
Tabel 4.1	Imbal hasil harian LQ45	46
Tabel 4.2	<i>Daily historical volatility</i> LQ45.....	46
Tabel 4.3	<i>Annual Historical Volatility</i> LQ45.....	47
Tabel 4.4	Pengujian AIC, SIC, <i>Adjusted R²</i> dan SSE	50
Tabel 4.5	Hasil parameter GARCH	51
Tabel 4.6	Perhitungan volatilitas GARCH	52
Tabel 4.7	Perbandingan perhitungan volatilitas	54
Tabel 4.8	Pengujian Black Scholes & GARCH dengan periode 1 bulan (data dianalisa per tahun)	55
Tabel 4.9	Perbandingan nilai AMSE data 10 tahun (1 bulan jatuh tempo)	56
Tabel 4.10	Analisa penggunaan strategi pada Black Scholes dan GARCH dengan jatuh tempo 1 bulan	56
Tabel 4.11	Analisa strategi <i>long straddle</i> per tahun (1 bulan jatuh tempo)	57
Tabel 4.11	Pengujian Black Scholes & GARCH dengan periode 2 bulan (data dianalisa per tahun)	58
Tabel 4.13	Perbandingan nilai AMSE data 10 tahun (2 bulan jatuh tempo)	59
Tabel 4.14	Analisa penggunaan strategi pada Black Scholes dan GARCH dengan jatuh tempo 2 bulan	59
Tabel 4.15	Analisa strategi <i>long straddle</i> per tahun (2 bulan jatuh tempo)	60
Tabel 4.16	Pengujian Black Scholes & GARCH dengan periode 3 bulan (data dianalisa per tahun)	61
Tabel 4.17	Perbandingan nilai AMSE data 10 tahun (3 bulan jatuh tempo)	62

Tabel 4.18 Analisa penggunaan strategi pada Black Scholes dan GARCH dengan jatuh tempo 3 bulan	62
Tabel 4.19 Analisa strategi <i>long straddle</i> per tahun (3 bulan jatuh tempo)	63