

# 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
1. Pendahuluan.....	1
1.1. Latar Belakang .....	1
1.2. Perumusan Masalah.....	2
1.3. Batasan Masalah.....	2
1.4. Tujuan.....	2
1.5. Metodologi Penyelesaian Masalah.....	2
1.6. Sistematika Pembahasan .....	3
2. Tinjauan Pustaka.....	5
2.1. Return .....	5
2.2. Volatilitas .....	6
2.3. Konsep Asimetris .....	7
2.4. Model Generalized Autoregressive Conditional Heteroscedasticity .....	8
2.5. Model Stochastic Volatility Autoregressive .....	9
2.6. Fungsi Likelihood .....	9
2.7. Kriteria Pemilihan Model Terbaik dan Validasi Model.....	10
3. Perancangan Sistem.....	11
3.1. Deskripsi Sistem.....	11
3.2. Data .....	11
3.2.1 Statistika Deskriptif .....	11
3.3. Alur Perancangan Sistem .....	12
3.3.1 Perancangan Sistem Model GARCH (1,1) .....	13
3.3.2 Perancangan Sistem Model SVAR (1) .....	14
4. Implementasi Hasil .....	15
4.1. Analisis Data .....	15

4.2.	Model GARCH (1,1).....	16
4.2.1	Fungsi Likelihood Model GARCH (1,1).....	16
4.2.2	Nilai Parameter dari Metode Maksimum Likelihood .....	17
4.2.3	Analisis Sifat Asimetris atau Leverage Effect pada Model .....	18
4.3	Model SVAR (1).....	19
4.3.1	Nilai Parameter dari Metode Maksimum Likelihood .....	20
4.3.2	Analisis Sifat Asimetris atau Leverage Effect pada Model .....	21
4.4.	Validasi Model .....	22
4.5.	Eksperimen Dengan Data Lain atau Pembandingan.....	23
5.	Kesimpulan dan Saran .....	27
5.1.	Kesimpulan.....	27
5.2.	Saran.....	27
	Daftar Pustaka.....	28
	Lampiran .....	29
L.1.	Definisi Model GARCH (1,1).....	29
L.1.1	Sifat Distribusi Model GARCH (1,1).....	29
L.2.	Definisi Model SVAR (1) .....	31
L.2.1	Sifat Distribusi Model SVAR(1) .....	31
	Lampiran A : Kode Matlab Model Volatilitas Data .....	33
	Lampiran B : Kode Matlab Simulasi Model GARCH (1,1) .....	33
	Lampiran C : Kode Matlab Simulasi Model SVAR (1) .....	35