

DAFTAR TABEL

Tabel 1.1	Imbal Hasil Harian INAF Selama 20 Tahun.....	4
Tabel 1.2	Imbal Hasil Harian KAEF Selama 20 Tahun.....	5
Tabel 2.1	Daftar Penelitian Sebelumnya.....	22
Tabel 3.1	Karakteristik Penelitian.....	32
Tabel 3.2	Operasional Variabel.....	32
Tabel 4.1	Variabel Lengkap GARCH (1,1).....	38
Tabel 4.2	Historical Volatility Black Scholes dan Volatilitas GARCH INAF Periode 2002-2021.....	38
Tabel 4.3	Historical Volatility Black Scholes dan Volatilitas GARCH KAEF Periode 2002-2021.....	39
Tabel 4.4	Perhitungan Untung atau Rugi Strategi Long Straddle.....	41
Tabel 4.5	Persentase Keuntungan INAF & KAEF untuk model Black Scholes dan GARCH Periode 2002-2021.....	42
Tabel 4.6	Hasil Perhitungan AMSE Black Scholes dan GARCH Periode 2002- 2021 pada INAF.....	43
Tabel 4.7	Hasil Perhitungan AMSE Black Scholes dan GARCH Periode 2002- 2021 pada KAEF.....	44
Tabel 4.8	Hasil AMSE Black Scholes & GARCH.....	45