

DAFTAR ISI

HAK CIPTA	i
PERNYATAAN.....	ii
UCAPAN TERIMAKASIH.....	iii
ABSTRAK	iv
ABSTRACT.....	v
KATA PENGANTAR.....	vi
DAFTAR ISI.....	vii
DAFTAR TABEL	ix
DAFTAR GAMBAR.....	x
DAFTAR LAMPIRAN	xi
BAB I PENDAHULUAN.....	1
1.1. Latar Belakang.....	1
1.2. Batasan Masalah.....	2
1.3. Rumusan Masalah	3
1.4. Tujuan Penelitian.....	3
1.5. Manfaat Penelitian.....	3
BAB II KAJIAN PUSTAKA	4
2.1. Saham dan Harga Saham.....	4
2.2. <i>Return</i> Saham	5
2.3. Volatilitas	6
2.4. <i>Skewness</i> dan Kurtosis.....	7
2.5. Peak Over Threshold	8
2.6. Distribusi Normal	10
2.7. Distribusi Lognormal.....	10
2.8. Maksimum <i>Likelihood</i>	11
2.9. Proses Stokastik	12
2.9.1. Proses Poisson	13
2.10. Persamaan Diferensial Stokastik (PDS).....	13
2.11. MAPE (Mean Absolute Percentage Error).....	14

BAB III METODE PENELITIAN	16
3.1. <i>Jump Diffusion</i>	16
3.2. Pengambilan Data.....	17
3.3. Perhitungan Nilai <i>Return</i> dan Volatilitas Saham.....	17
3.4. Pemotongan <i>jump</i> pada Data <i>Return</i> Saham	17
3.5. Estimasi Parameter	18
3.5.1. Estimasi α dan σ	18
3.5.2. Estimasi λ	19
3.5.3. Estimasi μ dan δ	20
3.6. Model Harga Saham <i>Jump Diffusion</i>	22
3.6.1. Proses Ito	22
3.6.2. Proses $It\hat{o}$ untuk <i>Jump Diffusion</i>	24
3.7. Prediksi Harga Saham dan Perhitungan MAPE	27
BAB IV HASIL DAN PEMBAHASAN	28
4.1. Perhitungan Nilai <i>Return</i> dan Volatilitas Saham.....	28
4.2. Pemotongan <i>jump</i> pada Data <i>return</i> Saham	30
4.3. Estimasi Parameter	32
4.3.1. Estimasi α dan σ	32
4.3.2. Estimasi λ	32
4.3.3. Estimasi μ dan δ	32
4.5. Model Harga Saham <i>Jump Diffusion</i>	33
4.6. Prediksi Harga Saham dan Perhitungan MAPE	33
BAB V KESIMPULAN DAN SARAN	36
5.1. Kesimpulan.....	36
5.2. Saran	36
DAFTAR PUSTAKA.....	37
LAMPIRAN	39