

DAFTAR ISI

HALAMAN PENGESAHAN I	i
HALAMAN PENGESAHAN II	ii
KATA PENGANTAR.....	iii
ABSTRAK	iv
ABSTRACT.....	v
DAFTAR ISI.....	vi
DAFTAR GAMBAR	viii
DAFTAR TABEL.....	ix
DAFTAR LAMPIRAN	x
BAB I PENDAHULUAN.....	1
1.1 Latar Belakang.....	1
1.2 Rumusan Masalah.....	10
1.3 Batasan Masalah	10
1.4 Tujuan Penelitian	11
BAB II TINJAUAN PUSTAKA	12
2.1 Investasi	12
2.2 PT Bank Negara Indonesia (Persero) Tbk.	13
2.3 Indeks LQ45	14
2.4 Saham.....	14
2.4.1 Harga Saham	15
2.4.2 <i>Return</i>	15
2.4.3 Volatilitas	17
2.5 Uji Normalitas Kolmogorov-Smirnov	17
2.6 Proses Wiener	18
2.7 <i>Geometric Brownian Motion</i>	19

2.7.1	<i>2-Dimensional Geometric Brownian Motion</i>	19
2.7.2	Persamaan Diferensial Stokastik	20
2.7.3	Proses $It\hat{o}$	21
2.7.4	Teorema $It\hat{o}$	21
2.8	MAPE (<i>Mean Absolute Percentage Error</i>)	22
2.9	<i>Historical Simulation Value at Risk</i>	23
BAB III METODE PENELITIAN.....		25
3.1	Jenis dan Sumber Data.....	25
3.2	Variabel Penelitian.....	25
3.3	Tahapan Analisis Data	25
3.4	Diagram Alir Analisis Data	27
BAB IV HASIL DAN PEMBAHASAN.....		29
4.1	Deskripsi Data.....	29
4.2	Penentuan Data <i>In Sample</i> dan Data <i>Out Sample</i>	29
4.3	Perhitungan <i>Return Data In Sample</i>	30
4.4	Uji Normalitas Data <i>In Sample Return Saham</i>	31
4.5	Estimasi Parameter <i>2-Dimensional Geometric Brownian Motion</i>	32
4.6	Model <i>2-Dimensional Geometric Brownian Motion</i>	34
4.7	Prediksi Harga Saham.....	34
4.8	Penentuan Nilai MAPE.....	36
4.9	Perbandingan Harga Saham Aktual dan Harga Saham Prediksi	37
4.10	<i>Value at Risk</i> Harga Saham Prediksi dengan <i>Historical Simulation</i> ...	37
BAB V KESIMPULAN		41
DAFTAR PUSTAKA		43
LAMPIRAN		46