



DAFTAR ISI

HALAMAN JUDUL	i
HALAMAN PENGESAHAN	ii
HALAMAN PERNYATAAN	iii
HALAMAN PERSEMBAHAN	iv
HALAMAN MOTTO	v
PRAKATA	vi
DAFTAR ISI	viii
DAFTAR GAMBAR	x
DAFTAR LAMBANG	xi
INTISARI	xii
ABSTRACT	xiii
I PENDAHULUAN	1
1.1 Latar Belakang Masalah	1
1.2 Tujuan dan Manfaat Penelitian	3
1.3 Tinjauan Pustaka	3
1.4 Metode Penelitian	4
1.5 Sistematika Penulisan	5
II DASAR TEORI	6
2.1 Teori Probabilitas	6
2.1.1 Ruang Probabilitas	6
2.1.2 Variabel Random	9
2.1.3 Ekspektasi dan Variansi	11
2.1.4 Independensi	13
2.1.5 Konvergensi	15
2.1.6 Variabel Random Normal	20
2.1.7 Proses Stokastik	23
2.1.8 <i>Martingale</i>	24
2.2 Fungsi L^2 -Carathéodory	26
2.3 <i>Brownian Motion</i> dan <i>White Noise</i>	28
2.4 Integral Itô dan formula Itô	38
2.5 Teorema Arzelá-Ascoli	51
2.6 Teorema Titik Tetap Schaefer	53
2.7 Persamaan Diferensial Stokastik	53



III PERSAMAAN DIFERENSIAL IMPULSIF STOKASTIK	65
3.1 Eksistensi Solusi Persamaan Diferensial Impulsif Stokastik	65
3.2 Ketunggalan Solusi Persamaan Diferensial Impulsif Stokastik	72
IV STUDI KASUS HARGA SAHAM PT INDOMOBIL SUKSES INTER- NASIONAL Tbk	76
4.1 Persamaan Diferensial Impulsif Stokastik Terkait Harga Saham	76
4.2 Simulasi Solusi Persamaan Diferensial Impulsif Stokastik	79
V KESIMPULAN	85
DAFTAR PUSTAKA	86
A DATA HARGA SAHAM	88
B SKRIP PROGRAM MATLAB	94
2.1 Skrip Matlab untuk Membangun <i>Brownian motion</i>	94
2.2 Skrip Matlab untuk Membangun Fungsi elementer	96
2.3 Skrip Matlab untuk Simulasi Solusi Persamaan Diferensial Stokastik	97
2.4 Skrip Matlab untuk Mencari Konstanta Drift dan Volatilitas	98
2.5 Skrip Matlab untuk Simulasi Solusi Persamaan Diferensial Impulsif Stokastik	99