

## DAFTAR ISI

PRAKATA	i
DAFTAR ISI	ii
DAFTAR GAMBAR	iv
DAFTAR TABEL	v
DAFTAR LAMBANG DAN SINGKATAN	vii
INTISARI	viii
ABSTRAK	ix
BAB I PENDAHULUAN	1
1.1. Latar Belakang	1
1.2. Rumusan Masalah	4
1.3. Batasan Masalah	4
1.4. Tujuan Penelitian	4
1.5. Manfaat Penelitian	5
1.6. Metode Penelitian	5
3.6.1. Alat dan Bahan	5
3.6.2. Prosedur atau Tahapan Penelitian	5
1.7. Tinjauan Pustaka	8
1.8. Sistematika Penulisan	9
BAB II LANDASAN TEORI	11
2.1. Pasar Valuta Asing	11
2.1.1. Penetapan Mata Uang: <i>Direct</i> dan <i>Indirect</i>	12
2.1.2. <i>Cross Rate</i>	12
2.2. Gerak Brown	13
2.2.1. Gerak Brown	13
2.2.2. Gerak Brown (Proses Wiener) Standar	15
2.3. Proses Stokastik	16
2.3.1. Teori Probabilitas	16
2.3.2. Definisi Proses Stokastik	17
2.3.3. Proses Markov	17
2.3.4. Proses Difusi	18
2.3.5. Persamaan Diferensial Stokastik	18
2.3.6. Proses Itô	18
2.3.7. Persamaan Fokker-Planck	20
2.4. Gerak Brown Geometrik	20
BAB III PERSAMAAN FOKKER PLANCK BAGI PROSES GERAK BROWN GEOMETRIK LN RETURN KURS MATA UANG	21
3.1. Persamaan Fokker-Planck bagi Persamaan Diferensial Gerak Brown Geometrik Brown Geometrik	21

3.2. ...Penyelesaian Persamaan Fokker-Planck Gerak Brown	
Geometrik	22
BAB. IV PENCOCOKKAN DISTRIBUSI GAUSSIAN DAN DISTRIBUSI	
GERAK BROWN GEOMETRIK DENGAN RAPAT PELUANG	
EMPIRIS	26
BAB. V KESIMPULAN DAN SARAN	41
5.1. Kesimpulan	41
5.2. Saran	41
DAFTAR PUSTAKA	42
PENGELOMPOKKAN LN RETURN	44
PROGRAM PENCARIAN VARIABEL DISTRIBUSI GAUSSIAN DAN	
GERAK BROWN GEOMETRIK	47