



DAFTAR ISI

SKRIPSI.....	ii
HALAMAN PENGESAHAN.....	iii
HALAMAN PERNYATAAN.....	iv
KATA PENGANTAR.....	v
HALAMAN MOTTO DAN PERSEMBAHAN.....	vii
DAFTAR ISI.....	viii
DAFTAR GAMBAR.....	xii
DAFTAR TABEL.....	xiii
DAFTAR LAMPIRAN.....	xiv
INTISARI.....	xv
ABSTRACT.....	xvi
BAB I PENDAHULUAN.....	1
1.1 Latar Belakang.....	1
1.2 Tujuan Penelitian.....	3
1.3 Pembatasan Masalah.....	4
1.4 Tinjauan Pustaka.....	4
1.5 Metode Penulisan.....	5
1.6 Sistematika Penulisan.....	6
BAB II DASAR TEORI.....	8
2.1 Probabilitas.....	8
2.1.1 Definisi Probabilitas.....	8
2.1.2 Probabilitas Bersyarat.....	8
2.2 Variabel Random.....	8
2.2.1 Ekspektasi dan Variansi.....	9



2.2.2	Distribusi Peluang Bersama.....	10
2.2.3	Distribusi Bersyarat.....	11
2.2.4	Ekspektasi dan Variansi Bersyarat.....	11
2.3	Fungsi Regresi Nonparametrik.....	13
2.4	Teknik Smoothing.....	13
2.5	Pemilihan Parameter Bandwidth Optimal.....	14
2.5.1	Cross Validation Method.....	14
2.6	ARIMA (<i>Autoregressive Moving Average</i>).....	17
2.6.1	Pengertian.....	17
2.6.2	Stasioneritas dan Nonstasioneritas.....	18
2.6.3	Klasifikasi Model ARIMA.....	18
2.7	Distribusi Normal.....	20
2.7.1	Mean dan Variansi Distribusi Normal.....	20
2.8	Distribusi Normal Standar.....	22
2.9	Distribusi Invers Gaussian.....	22
2.10	Distribusi Gamma.....	24
2.10.1	Mean dan Variansi.....	25
2.11	Proses Stokastik.....	26
2.11.1	Pengertian.....	26
2.11.2	Proses Waktu Diskrit dan Kontinu.....	27
2.11.3	Inkremen Bebas.....	28
2.11.4	Inkremen Stasioner.....	28
2.11.5	Proses Wiener dan Gerak Brown Geometris.....	28
2.11.6	Martingale.....	29
2.11.7	Persamaan Diferensial Stokastik.....	30
2.12	Lemma Ito.....	31
2.12.1	Formula Ito.....	31



2.12.2	Integral Ito.....	31
2.13	Volatilitas.....	33
2.14	Deret.....	34
2.14.1	Deret Taylor.....	34
2.14.2	Deret Mac Laurin.....	34
2.15	Perhitungan MSE.....	35
2.16	Teori Bunga.....	37
2.16.1	Bunga Sederhana.....	37
2.16.2	Bunga Majemuk.....	37
2.16.3	Hubungan antara Suku Bunga Efektif dan Nominal.....	38
2.16.4	Suku Bunga Bank Indonesia (<i>BI rate</i>).....	38
BAB III ESTIMASI TINGKAT SUKU BUNGA MENGGUNAKAN METODE NONPARAMETRIK KERNEL.....		40
3.1	Fungsi Kernel.....	40
3.1.1	Definisi Fungsi Kernel.....	40
3.1.2	Gamma Kernel.....	40
3.1.3	Gaussian Kernel.....	43
3.2	Infinitesimal Generator.....	43
3.2	Estimasi Fungsi Drift dan Fungsi Difusi.....	47
3.3.1	Metode Gamma Kernel.....	47
3.3.2	Metode Gaussian Kernel.....	51
BAB IV STUDI KASUS.....		54
4.1	Deskripsi Data.....	54
4.2	Estimasi Parameter <i>Smoothing</i>	54
4.3	Estimasi Fungsi Drift dan Fungsi Difusi.....	56
4.3.1	Gamma Kernel.....	56
4.3.2	Gaussian Kernel.....	58



4.4	Estimasi Suku Bunga Menggunakan Gamma Kernel.....	60
4.5	Estimasi Suku Bunga Menggunakan Gaussian Kernel.....	62
4.6	Perbandingan Dua Metode Estimasi.....	65
4.7	Perbandingan Estimasi Gamma Kernel untuk Beberapa <i>Design Point</i>	66
BAB V PENUTUP.....		69
5.1	Kesimpulan.....	69
5.2	Saran.....	70
DAFTAR PUSTAKA.....		71
LAMPIRAN.....		74