

DAFTAR ISI

HALAMAN PENGESAHAN.....	iii
PERNYATAAN.....	iv
PRAKATA.....	v
DAFTAR ISI.....	viii
DAFTAR TABEL.....	x
DAFTAR GAMBAR.....	xi
DAFTAR NOTASI.....	xiii
INTISARI.....	xiv
ABSTRACT.....	xv
I PENDAHULUAN.....	1
1.1 Latar Belakang Masalah.....	1
1.2 Rumusan Masalah.....	6
1.3 Tujuan Penelitian.....	6
1.4 Batasan Masalah.....	6
1.5 Manfaat Penelitian.....	6
1.6 Sistematika Penulisan.....	6
1.7 Tinjauan Pustaka.....	7
1.8 Metode Penelitian.....	9
II LANDASAN TEORI.....	11
2.1 Teori Penskalaan dan Skala Waktu di Pasar Keuangan.....	11
2.1.1 Skala harga pada pasar keuangan.....	13
2.1.2 Skala waktu pada pasar keuangan.....	15
2.2 Teori Peluang.....	17
2.2.1 Peubah acak.....	19
2.2.2 Distribusi peluang kumulatif dan kerapatan peluang.....	20
2.2.3 Nilai harap dan simpangan baku.....	28
2.3 Proses Stokastik.....	29
2.3.1 Proses Wiener.....	30
2.3.2 Proses <i>Levy</i>	32
2.4 Tentang Pasar Modal.....	33

2.4.1	Indeks LQ-45	34
2.4.2	Saham PT. Telekomunikasi Indonesia Tbk.	35
III DISTRIBUSI <i>RETURN</i> PADA BERBAGAI SKALA WAKTU		36
3.1	Perhitungan Rapat Peluang <i>Return</i>	38
3.2	Pencocokan Rapat Peluang Empiris Indeks LQ-45	39
3.2.1	Rentang waktu 2004 – 2015.....	39
3.2.2	Rentang waktu 2013 – 2017.....	48
3.2.3	Rentang waktu 2004 – 2017.....	57
3.3	Pencocokan Rapat Peluang Empiris Saham Telkom pada rentang waktu 2004 - 2015	70
3.3.1	Skala waktu harian	70
3.3.2	Skala waktu mingguan	74
3.4	Analisis Distribusi <i>Return</i>	83
IV KESIMPULAN DAN SARAN		86
4.1	Kesimpulan.....	86
4.2	Saran	86
DAFTAR PUSTAKA		88
LAMPIRAN A KONSTANTA DISTRIBUSI RAPAT PELUANG <i>RETURN</i>		92

DAFTAR TABEL

3.1 Konstanta hasil pencocokkan distribusi normal Indeks LQ-45	66
3.2 Konstanta hasil pencocokkan distribusi eksponensial Indeks LQ-45	67
3.3 Konstanta hasil pencocokkan distribusi hukum pangkat Indeks LQ-45	68
3.4 Konstanta hasil pencocokkan distribusi lognormal Indeks LQ-45	69
3.5 Konstanta hasil pencocokkan distribusi normal saham Telkom	79
3.6 Konstanta hasil pencocokkan distribusi eksponensial saham Telkom.....	80
3.7 Konstanta hasil pencocokkan distribusi hukum pangkat saham Telkom.....	81
3.8 Konstanta hasil pencocokkan distribusi lognormal saham Telkom.....	82
A.1 Konstanta distribusi rapat peluang <i>return</i>	92

DAFTAR GAMBAR

Gambar 2.1 Data eksperimen MHT	12
Gambar 2.2 Kurva distribusi normal.....	22
Gambar 2.3 Kurva distribusi eksponensial	25
Gambar 2.4 Kurva distribusi lognormal	26
Gambar 2.5 Kurva distribusi <i>power law</i>	27
Gambar 3.1 Pergerakan harga saham Indeks LQ-45	37
Gambar 3.2 Pergerakan harga saham PT Telekomunikasi Indonesia.....	37
Gambar 3.3 Kurva distribusi Indeks LQ-45 tahun 2004 – 2015 (Harian)	39
Gambar 3.4 Kurva distribusi Indeks LQ-45 tahun 2004 – 2015 ekor kiri (Harian)	40
Gambar 3.5 Kurva distribusi Indeks LQ-45 tahun 2004 – 2015 ekor kanan (Harian)	40
Gambar 3.6 Kurva distribusi Indeks LQ-45 tahun 2004 – 2015 (Mingguan).....	43
Gambar 3.7 Kurva distribusi Indeks LQ-45 tahun 2004 – 2015 ekor kiri (Mingguan)	44
Gambar 3.8 Kurva distribusi Indeks LQ-45 tahun 2004 – 2015 ekor kanan (Mingguan).....	45
Gambar 3.9 Kurva distribusi Indeks LQ-45 tahun 2013 – 2017 (Harian)	48
Gambar 3.10 Kurva distribusi Indeks LQ-45 tahun 2013 – 2017 ekor kiri (Harian)	49
Gambar 3.11 Kurva distribusi Indeks LQ-45 tahun 2013 – 2017 ekor kanan (Harian)	49
Gambar 3.12 Kurva distribusi Indeks LQ-45 tahun 2013 – 2017 (Mingguan).....	52
Gambar 4.13 Kurva distribusi Indeks LQ-45 tahun 2013 – 2017 ekor kiri (Mingguan).....	53
Gambar 4.14 Kurva distribusi Indeks LQ-45 tahun 2013 – 2017 ekor kanan (Mingguan).....	54
Gambar 4.15 Kurva distribusi Indeks LQ-45 tahun 2004 – 2017 (Harian)	57

Gambar 4.16 Kurva distribusi Indeks LQ-45 tahun 2004 – 2017 ekor kiri (Harian)	58
Gambar 4.17 Kurva distribusi Indeks LQ-45 tahun 2004 – 2017 ekor kanan (Harian)	58
Gambar 4.18 Kurva distribusi Indeks LQ-45 tahun 2004 –2017 (Mingguan).....	61
Gambar 4.19 Kurva distribusi Indeks LQ-45 tahun 2004 – 2017 ekor kiri (Mingguan).....	62
Gambar 4.20 Kurva distribusi Indeks LQ-45 tahun 2004 – 2017 ekor kanan (Mingguan).....	63
Gambar 4.21 Kurva distribusi saham Telkom tahun 2004 – 2015 (Harian).....	70
Gambar 4.22 Kurva distribusi saham Telkom tahun 2004 – 2015 ekor kiri (Harian)	71
Gambar 4.23 Kurva distribusi saham Telkom tahun 2004 – 2015 ekor kanan (Harian)	71
Gambar 4.24 Kurva distribusi saham Telkom tahun 2004 – 2015 (Mingguan) ...	74
Gambar 4.25 Kurva distribusi saham Telkom tahun 2004 – 2015 ekor kiri (Mingguan).....	75
Gambar 4.26 Kurva distribusi saham Telkom tahun 2004 – 2015 ekor kanan (Mingguan).....	76

DAFTAR NOTASI

$Y(t)$	harga aset keuangan (harga saham)	$\rho(x)$	fungsi peluang
$Z(t)$	perubahan harga saham	σ^2	variansi
$Z_D(t)$	perubahan harga saham dengan diskon	m	nilai harap distribusi lognormal
$R(t)$	<i>return</i> harga saham	δ	variansi distribusi lognormal
$S(t)$	<i>return</i> logaritma harga saham	α	konstanta hukum pangkat
Ω	ruang sampel	λ	konstanta peluruhan
\mathcal{A}	aljabar- σ	X	peubah acak
P	peluang	\mathcal{W}	<i>white noise</i>
\mathbb{R}	himpunan bilangan real	W	proses Wiener
\emptyset	himpunan kosong	L	proses Lèv
\mathcal{B}	himpunan borel		
A_x	prabayangan himpunan borel		
P_X	distribusi peluang		
$n_{S(t)}$	jumlah nilai dalam suatu wadah <i>return</i> $S(t)$		
τ	ketebalan optis		
l	panjang gelombang		
t	waktu		
\mathcal{N}	jumlah seluruh data <i>return</i>		
N	jumlah atom radioaktif		
F_X	distribusi peluang kumulatif		
p_x	distribusi kerapatan peluang		
μ	nilai harap		
σ	simpangan baku		



UNIVERSITAS
GADJAH MADA

**PENCOCOKAN DISTRIBUSI RETURN INDEKS LQ 45 DAN HARGA SAHAM PT TELEKOMUNIKASI
INDONESIA DI BURSA EFEK
INDONESIA DENGAN DISTRIBUSI NORMAL, DISTRIBUSI EKSPONENSIAL, DISTRIBUSI HUKUM
PANGKAT DAN DISTRIBUSI
LOGNORMAL PADA SKALA WAKTU HARIAN DAN MINGGUAN**
BIMO ANUGRAH PUTRA M, Dr. Dwi Satya Palupi
Universitas Gadjah Mada, 2017 | Diunduh dari <http://etd.repository.ugm.ac.id/>