

DAFTAR ISI

LEMBAR PENGESAHAN	i
HALAMAN PERNYATAAN PERSETUJUAN.....	iii
HALAMAN PERNYATAAN ORISINALITAS	v
ABSTRAK	vii
ABSTRACT	ix
KATA PENGANTAR.....	xi
DAFTAR ISI.....	xiv
DAFTAR TABEL	xvi
DAFTAR GAMBAR.....	xviii
BAB 1 PENDAHULUAN	1
1.1 Latar Belakang	1
1.2 Rumusan Masalah	4
1.3 Tujuan Penelitian.....	4
1.4 Batasan Masalah.....	4
1.5 Manfaat Penelitian.....	5
BAB 2 TINJAUAN PUSTAKA.....	7
2.1 <i>E-commerce</i>	7
2.2 <i>Return</i>	7
2.3 Pengujian Normalitas	7
2.4 <i>Mixture Laplace Autoregressive (MLAR)</i>	8
2.5 Estimasi Parameter	10
2.6 <i>Value at Risk (VaR)</i>	10
2.7 <i>Backtesting</i>	11

2.8 <i>Deviance Information Criterion</i> (DIC)	12
BAB 3 METODE PENELITIAN	15
3.1 Sumber Data	15
3.2 Metode Analisis.....	16
3.3 Diagram Alir Penelitian.....	19
BAB 4 ANALISIS DAN PEMBAHASAN	21
4.1 Identifikasi Model ARIMA	21
4.2 Penentuan Distribusi <i>Prior</i>	22
4.3 Pemodelan <i>Mixture Laplace Autoregressive</i> (MLAR)	24
4.4 Pemilihan Model Terbaik	37
4.5 Perhitungan Value at Risk (VaR).....	37
4.6 Backtesting Hasil Estimasi VaR.....	40
4.6.1 Statistik Uji	40
BAB 5 KESIMPULAN DAN SARAN	43
5.1 Kesimpulan.....	43
5.2 Saran	43
DAFTAR PUSTAKA	45
LAMPIRAN A.....	1
LAMPIRAN B	2
LAMPIRAN C	4
LAMPIRAN D.....	11