

DAFTAR TABEL

Tabel 2.1 Persamaan dan Perbedaan dengan Penelitian Terdahulu.....	19
Tabel 3.1 Karakteristik Penelitian.....	25
Tabel 3.2 Variabel Operasional.. ..	26
Tabel 4.1 Statistik Deskriptif.....	37
Tabel 4.2 Hasil Uji <i>Unit Root</i> Kurs dengan Metode ADF.....	39
Tabel 4.3 Hasil Uji <i>Unit Root</i> IHSG dengan Metode ADF.....	40
Tabel 4.4 Hasil Uji <i>Unit Root return</i> Kurs dalam <i>First Difference</i>	43
Tabel 4.5 Hasil Uji <i>Unit Root return</i> IHSG dalam <i>First Difference</i>	44
Tabel 4.6 Uji Heteroskedastisitas dengan ARCH.....	46
Tabel 4.7 Model EGARCH.....	48
Tabel 4.8 Hasil Uji <i>Serial Correlation</i>	50
Tabel 4.9 Hasil Uji ARCH-LM (<i>Lagrange Multiplier</i>)	51
Tabel 4.10 Hasil Uji <i>Granger Causality</i>	53