

Daftar Tabel

2.1	Identifikasi Model Time Series berdasarkan ACF dan PACF . . .	5
2.2	Keterangan variabel model AR dan GARCH	10
3.1	Hasil Statistika Deskriptif	14
4.1	Uji Efek ARCH saham NASDAQ dan NYSE	17
4.2	Nilai parameter AR(1)	18
4.3	Nilai parameter GARCH(1,1)	19
4.4	Nilai VaR <i>Violation</i> dan Tingkat Error	23