

DAFTAR TABEL

Tabel 1.1 Daftar Saham pada Indeks Kompas 100 periode 2012- 2016.....	2
Tabel 2. 1 Variasi ARCH/ GARCH.....	25
Tabel 2. 2 Persamaan dan Perbedaan dengan Penelitian Terdahulu.....	32
Tabel 3. 1 Jenis Penelitian	37
Tabel 3. 2 Variabel Operasional	38
Tabel 4.1 Statistik Deskriptif Data Penelitian.....	51
Tabel 4.2 Hasil Uji ADF Kurs Tengah Rupiah per US Dollar pada <i>level</i> ...	54
Tabel 4.3 Hasil Uji ADF <i>Return</i> Kurs Tengah Rupiah per US Dollar	55
Tabel 4.4 Hasil Uji ADF Harga Penutupan (<i>Close</i>) Indeks Saham Kompas100 pada <i>level</i>	57
Tabel 4.5 Hasil Uji ADF <i>Return</i> Indeks Saham Kompas100	57
Tabel 4.6 Hasil Uji White	59
Tabel 4.7 Hasil Uji ARMA <i>Return</i> Indeks Saham Kompas100 yang Signifikan pada Taraf Nyata 5%.....	60
Tabel 4.8 Hasil Estimasi ARMA (1,3) pada <i>Return</i> Indeks Saham Kompas100	61
Tabel 4.9 Rangkuman Hasil Pengujian GARCH (p,q)	62
Tabel 4.10 Hasil <i>Mean Equation</i> GARCH(1,1) dengan ARMA(1,3)	64
Tabel 4.11 Hasil <i>Variance Equation</i> GARCH (1,1)	65
Tabel 4.12 Hasil Uji <i>Serial Correlation</i>	66
Tabel 4.13 Hasil Uji ARCH-LM	67
Tabel 4.14 Hasil Pra-pengujian <i>Lag Legth Criteria</i>	69
Tabel 4.15 Hasil Pengujian <i>Granger Causality</i> dengan <i>lag</i> 3	69