

DAFTAR LAMPIRAN

Lampiran 1	Data <i>Return</i> Saham Periode 1 Januari 2014 s.d 31 Desember 2015.....	115
Lampiran 2.1	Pengujian Data <i>Return</i> Saham Test Stationeritas.....	135
Lampiran 2.2	Pengujian Data <i>Return</i> Saham Test Normalitas.....	147
Lampiran 2.3	Pengujian Data <i>Return</i> Saham Test <i>White Heteroskedastic</i>	159
Lampiran 3	Perhitungan VaR dengan Model Volatilitas EWMA.....	182
Lampiran 4	Hasil Pengujian ARCH dan Perhitungan VaR dengan Model Volatilitas ARCH	188
Lampiran 5	Hasil Pengujian GARCH dan Perhitungan VaR dengan Model Volatilitas GARCH	200
Lampiran 6	Perhitungan VaR dengan Model Volatilitas Konstan.....	212

UNIVERSITAS
MERCU BUANA