

## DAFTAR TABEL

1.1. Pertumbuhan Rata-rata Indeks Harga Saham Global (2010-2016) .....	6
1.2. Research Gap Penelitian Sebelumnya .....	8
3.1. Ringkasan Indeks Saham Sektoral .....	38
3.2. Ringkasan Indeks Saham .....	38
3.3. Peneliti Terdahulu Metode ARCH/GARCH, TGARCH, EGARCH .....	42
3.4. Peneliti Terdahulu Selain Metode ARCH/GARCH, TGARCH, EGARCH .....	44
4.1. Definisi Operasional Variabel .....	57
4.2. Jenis dan Sumber Data Sekunder .....	58
5.1. Statistik Deskriptif Variabel Dependen dan Variabel Independen .....	73
5.2. Hasil Uji Stationeritas Augmented Dickey Fuller (ADF) .....	75
5.3. Hasil Pemilihan Model GARCH dengan Uji AIC dan SC .....	75
5.4. Hasil Pemilihan Model GARCH dengan Uji Signifikansi .....	76
5.5. Hasil Mean Model GARCH (1,1) .....	77
5.6. Hasil Varians Model GARCH (1,1) .....	78
5.7. Hasil Uji Heterokedastisitas Model GARCH (1,1) .....	79
5.8. Hasil Uji Multikolinearitas Model GARCH (1,1) .....	80
5.9. Hasil Uji Autokorelasi Model GARCH (1,1) .....	81
5.10. Hasil Uji Koefisien Determinasi (Uji R <sup>2</sup> ) Model GARCH (1,1) .....	82
5.11. Hasil Uji T-Statistik Model GARCH (1,1) .....	84