

Daftar Tabel

2.1	Variabel model GARCH	8
2.2	Variabel Langrange Multiplier	10
3.1	Hasil Statistika Deskriptif	25
4.1	Nilai <i>Engle's ARCH Test</i> untuk indeks saham Honda	27
4.2	Nilai <i>Engle's ARCH Test</i> untuk indeks saham Toyota	28
4.3	Parameter GARCH(1,0)	28
4.4	<i>Number of violation Value-at-Risk</i>	31
4.5	Prediksi VaR saat hari ke-999	33