

## DAFTAR ISI

SURAT KETERANGAN PENGANTI LEMBAR PENGESAHAN SKRIPSI...	i
PERNYATAAN BEBAS PLAGIASI .....	ii
KATA PENGANTAR .....	iii
DAFTAR ISI .....	v
Daftar Tabel .....	viii
Daftar Gambar.....	ix
Daftar Lampiran.....	x
Daftar Singkatan .....	xv
INTISARI .....	xvi
ABSTRACT .....	xvii
<b>BAB I. PENDAHULUAN .....</b>	<b>1</b>
1.1 Latar Belakang .....	1
1.2 Rumusan Masalah .....	1
1.3 Pertanyaan Penelitian .....	3
1.4 Tujuan Penelitian .....	3
1.5 Manfaat Penelitian .....	3
1.6 Ruang Lingkup dan Batasan Penelitian.....	4

1.7 Sistematika Penulisan .....	4
---------------------------------	---

## **BAB II. LANDASAN TEORI DAN TINJAUAN PUSTAKA ..... 6**

2.1 Landasan Teori .....	6
--------------------------	---

2.2 Tinjauan Pustaka .....	8
----------------------------	---

## **BAB III. METODOLOGI PENELITIAN ..... 11**

3.1 Desain Penelitian .....	11
-----------------------------	----

3.2 Definisi Operasional Variabel .....	12
---	----

3.3 Teknik Analisis Data .....	13
--------------------------------	----

## **BAB IV. HASIL PENELITIAN DAN PEMBAHASAN ..... 18**

4.1 Deskripsi Data .....	18
--------------------------	----

4.2 Hasil Uji Stasioneritas .....	21
-----------------------------------	----

4.3 Hasil Uji OLS .....	23
-------------------------	----

4.4 Hasil Uji AIC Model ARMA .....	24
------------------------------------	----

4.5 Hasil Uji Efek ARCH .....	27
-------------------------------	----

4.6 Hasil Uji AIC Model GARCH (p,q) .....	28
---	----

4.7 Hasil Estimasi ARCH (1) .....	29
-----------------------------------	----

4.8 Pembahasan Hasil .....	30
----------------------------	----

<b>BAB V. KESIMPULAN .....</b>	<b>32</b>
5.1 Kesimpulan .....	32
5.2 Keterbatasan .....	34
Daftar Pustaka .....	35
Lampiran .....	38