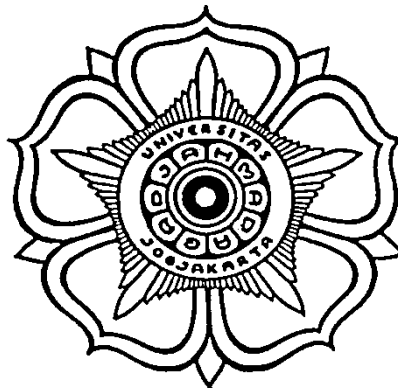


## SKRIPSI

**PERBANDINGAN MODEL VOLATILITAS RETURN  
MENGUNAKAN MODEL GLOSTEN-JAGANNATHAN-RUNKLE  
GARCH (GJR-GARCH) DAN EXPONENTIAL GARCH (EGARCH)**

***COMPARISON OF RETURN VOLATILITY MODELS USING GLOSTEN-  
JAGANNATHAN-RUNKLE GARCH (GJR-GARCH) AND  
EXPONENTIAL GARCH (EGARCH) MODEL***



FIRDAUS AL MAIDAH

10/300109/PA/13139

**PROGRAM STUDI STATISTIKA  
JURUSAN MATEMATIKA  
FAKULTAS MATEMATIKA DAN ILMU PENGETAHUAN ALAM  
UNIVERSITAS GADJAH MADA  
YOGYAKARTA**

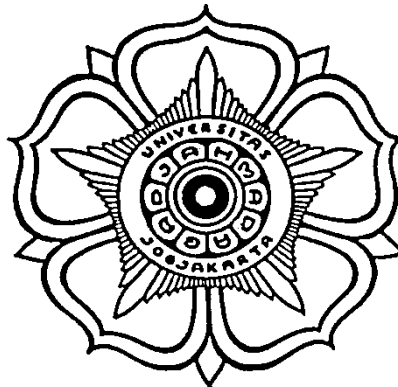
**2015**

## SKRIPSI

### PERBANDINGAN MODEL VOLATILITAS RETURN MENGUNAKAN MODEL GLOSTEN-JAGANNATHAN-RUNKLE GARCH (GJR-GARCH) DAN EXPONENTIAL GARCH (EGARCH)

### *COMPARISON OF RETURN VOLATILITY MODELS USING GLOSTEN- JAGANNATHAN-RUNKLE GARCH (GJR-GARCH) AND EXPONENTIAL GARCH (EGARCH) MODEL*

Diajukan untuk memenuhi salah satu syarat memperoleh derajat  
Sarjana Sains Matematika



FIRDAUS AL MAIDAH

10/300109/PA/13139

**PROGRAM STUDI STATISTIKA  
JURUSAN MATEMATIKA  
FAKULTAS MATEMATIKA DAN ILMU PENGETAHUAN ALAM  
UNIVERSITAS GADJAH MADA  
YOGYAKARTA**

**2015**