



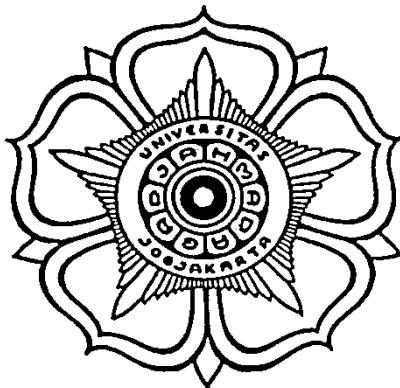
UNIVERSITAS
GADJAH MADA

Perbandingan Model Volatilitas Return dengan Menggunakan Model Glosten-Jagannathan-Runkle
GARCH (GJR-GARCH) dan Exponential GARCH (EGARCH)
FIRDAUS AL MAIDAH, Prof. Dr.rer.nat Dedi Rosadi, S.Si, M.Sc
Universitas Gadjah Mada, 2015 | Diunduh dari <http://etd.repository.ugm.ac.id/>

SKRIPSI

PERBANDINGAN MODEL VOLATILITAS RETURN MENGGUNAKAN 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

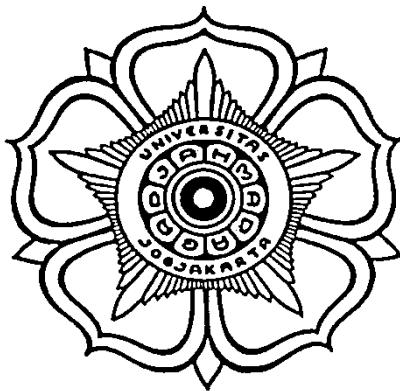
**PROGRAM STUDI STATISTIKA
JURUSAN MATEMATIKA
FAKULTAS MATEMATIKA DAN ILMU PENGETAHUAN ALAM
UNIVERSITAS GADJAH MADA
YOGYAKARTA
2015**

SKRIPSI

**PERBANDINGAN MODEL VOLATILITAS RETURN
MENGGUNAKAN 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**