

**PERAMALAN VOLATILITAS HARGA SAHAM
MENGUNAKAN MODEL ARCH/GARCH
(Studi pada Negara-Negara di ASEAN Tahun 2011-2017)**

TESIS

Diajukan untuk Memenuhi Salah Satu Syarat Memperoleh Gelar
Magister Manajemen Konsentrasi Keuangan



Oleh
Lia Puspa Anggita
1602634

**PROGRAM STUDI MAGISTER MANAJEMEN
SEKOLAH PASCA SARJANA**

Lia Puspa Anggita, 2019

*PERAMALAN VOLATILITAS HARGA SAHAM MENGGUNAKAN MODEL ARCH/GARCH
(Studi pada Negara-Negara di ASEAN Tahun 2011-2017)*

Universitas Pendidikan Indonesia | repository.upi.edu | perpustakaan.upi.edu

**UNIVERSITAS PENDIDIKAN INDONESIA
2018**

LEMBAR HAK CIPTA

**PERAMALAN VOLATILITAS HARGA SAHAM
MENGUNAKAN MODEL ARCH/GARCH
(Studi pada Negara-Negara di ASEAN Tahun 2011-2017)**

Oleh:

Lia Puspa Anggita

S.Pd Universitas Pendidikan Indonesia Bandung 2016

Sebuah tesis yang diajukan untuk memenuhi salah satu syarat
memperoleh gelar
Magister Manajemen Program Studi Magister Manajemen
Konsentrasi Manajemen Keuangan

©Lia Puspa Anggita 2018
Sekolah Pascasarjana
Universitas Pendidikan Indonesia
Mei 2018

Lia Puspa Anggita, 2019

**PERAMALAN VOLATILITAS HARGA SAHAM MENGGUNAKAN MODEL ARCH/GARCH
(Studi pada Negara-Negara di ASEAN Tahun 2011-2017)**

Universitas Pendidikan Indonesia | repository.upi.edu | perpustakaan.upi.edu

Hak cipta dilindungi Undang-undang
Tesis ini tidak boleh diperbanyak seluruhnya atau sebagian dengan
dicetak
ulang, difoto kopi, atau cara lainnya tanpa izin dari penulis.

LEMBAR PENGESAHAN

LIA PUSPA ANGGITA

PERAMALAN VOLATILITAS HARGA SAHAM
MENGUNAKAN MODEL ARCH/GARCH
(Studi pada Negara-Negara ASEAN Tahun 2011-2017)

Disetujui dan Disahkan Oleh:

Pembimbing I

Dr.H. Nugraha. SE..M.Si..Ak..CA
NIP. 19661226 199001 1002

Pembimbing II

Dr. Ikaputera Waspada , MM
NIP. 19610420 198703 1003

Mengetahui,

Lia Puspa Anggita, 2019

**PERAMALAN VOLATILITAS HARGA SAHAM MENGGUNAKAN MODEL ARCH/GARCH
(Studi pada Negara-Negara di ASEAN Tahun 2011-2017)**

Universitas Pendidikan Indonesia | repository.upi.edu | perpustakaan.upi.edu

Ketua Program Studi Manajemen
Sekolah Pasca Sarjana UPI

Prof. Dr. Hj. Ratih Hurriyati, M.P
NIP. 19680225 199301 2001

Lia Puspa Anggita, 2019

**PERAMALAN VOLATILITAS HARGA SAHAM MENGGUNAKAN MODEL ARCH/GARCH
(Studi pada Negara-Negara di ASEAN Tahun 2011-2017)**

Universitas Pendidikan Indonesia | repository.upi.edu | perpustakaan.upi.edu