

**ANALISIS PERBANDINGAN KINERJA *VALUE AT RISK* BERBASIS
ARCH, GARCH, DAN EGARCH SEBELUM, SAAT, DAN SETELAH
KRISIS GLOBAL TAHUN 2008 PADA JKSE, KLSE, STI, PSEI, HIS,
KOSPI, SSE DAN N225**

Diajukan sebagai salah satu syarat untuk memperoleh gelar Magister
Manajemen

Disusun oleh:

Pebri Yanida

212100609



SEKOLAH PASCA SARJANA

TELKOM UNIVERSITY

BANDUNG

2013