

DAFTAR LAMPIRAN

Lampiran	Judul Lampiran
1	Data Harian Saham LQ45 Periode Januari - September 2006
2	Data <i>Return</i> Saham LQ45 Periode Januari - September 2006
3	Estimasi Parameter Model ARIMA Terbaik <i>Return</i> Saham LQ45
4	Uji <i>White Noise</i> Model ARMA ([5],[11]) dengan <i>Correlogram of Residuals</i>
5	Uji Heteroskedastisitas Model ARMA ([5], [11]) dengan <i>Correlogram of Residuals Squared</i>
6	Uji <i>White Noise</i> Model EGARCH(1,1) dengan <i>Correlogram of Residuals</i>
7	Data <i>Return</i> Saham LQ45 Setelah Penghapusan <i>Outlier</i> Periode Januari - September 2006
8	<i>Correlogram of Return</i> Saham LQ45 Setelah Penghapusan <i>Outlier</i>
9	Estimasi Parameter Model ARIMA Terbaik <i>Return</i> Saham LQ45 Setelah Penghapusan <i>Outlier</i>
10	Uji <i>White Noise</i> Model ARMA ([1],0) Setelah Penghapusan <i>Outlier</i> dengan <i>Correlogram of Residuals</i>
11	Uji Heteroskedastisitas Model ARMA ([1],0) Setelah Penghapusan <i>Outlier</i> dengan <i>Correlogram of Residuals Squared</i>
12	Uji Normalitas Model EGARCH (1,1) dengan Histogram
13	Program S-PLUS Prosedur Pendeteksian <i>Outlier</i> Model EGARCH(1,1) dengan Menggunakan Uji Rasio <i>Likelihood</i>
14	Program S-PLUS Penghapusan <i>Outlier</i> Model EGARCH(1,1) dengan Menggunakan <i>Hampel Identifier</i>

- 15 Hasil *Output* Program S-PLUS Prosedur Pendeteksian *Outlier* Model EGARCH(1,1) dengan Menggunakan Uji Rasio *Likelihood*
- 16 Hasil *Output* Program S-PLUS Penghapusan *Outlier* Model EGARCH(1,1) dengan Menggunakan *Hampel Identifier*

