

**ANALISIS PENGARUH SUKU BUNGA SBI,
KURS RUPIAH/US\$, HARGA MINYAK DUNIA,
HARGA EMAS DUNIA, DJIA, NIKKEI 225 DAN
HANG SENG INDEX TERHADAP IHSG
DENGAN METODE GARCH-M**

(Periode Januari 2003 – Mei 2013)



SKRIPSI

**Diajukan sebagai salah satu syarat
untuk menyelesaikan Program Sarjana (S1)
pada Program Sarjana Fakultas Ekonomi
Universitas Diponegoro**

Disusun oleh :

FARIS HAMAM SYAROFI

NIM.12010110120060

FAKULTAS EKONOMIKA DAN BISNIS

UNIVERSITAS DIPONEGORO

SEMARANG

2014