

SKRIPSI

**ESTIMASI VOLATILITAS DAN PREDIKSI NILAI *RETURN*
INDEKS LQ45 DENGAN *MARKOV SWITCHING GARCH*
*MODEL***

Ditulis untuk memenuhi sebagian persyaratan akademik guna
memperoleh gelar Sarjana Sains Strata Satu

Oleh:

NAMA : ILLARIA HANA

NPM : 11220100001



**PROGRAM STUDI MATEMATIKA
FAKULTAS SAINS DAN TEKNOLOGI
UNIVERSITAS PELITA HARAPAN
TANGERANG
2014**