

## DAFTAR TABEL

Tabel 1.1 Indeks Saham China dan Indonesia 2011-2015 .....	4
Tabel 3.1 Karakteristik Penelitian.....	35
Tabel 3.2 Variabel Operasional.....	36
Tabel 4.1 Statistik Deskriptif .....	47
Tabel 4.2 Hasil Uji <i>Uni Root</i> SHCOMP dengan metode ADF.....	49
Tabel 4.3 Hasil Uji <i>Unit Root</i> IHSG dengan metode ADF.....	50
Tabel 4.4 Hasil Uji <i>Unit Root</i> Retrun SHCOMP dalam <i>First Difference</i> .....	53
Tabel 4.5 Hasil Uji <i>Unit Root</i> Retrun IHSG dalam <i>First Difference</i> .....	54
Tabel 4.6 Uji Heteroskedastisitas dengan ARCH.....	56
Tabel 4.7 Model EGARCH.....	57
Tabel 4.8 Hasil Uji <i>Serial Corellation</i> .....	58
Tabel 4.9 Hasil Uji ARCH-LM ( <i>Lagrange Multiplier</i> ) .....	59
Tabel 4.10 Hasil Uji <i>Granger Causality</i> .....	61