

DAFTAR ISI

HALAMAN JUDUL.....	i
HALAMAN PENGESAHAN.....	ii
HALAMAN PERNYATAAN	iii
KATA PENGANTAR	iv
ABSTRAK	vi
DAFTAR ISI.....	viii
DAFTAR TABEL.....	xi
DAFTAR GAMBAR	xii
BAB I PENDAHULUAN.....	1
1.1 Gambaran Umum Objek Penelitian	1
1.2 Latar Belakang Penelitian	3
1.3 Rumusan Masalah	12
1.4 Pertanyaan Penelitian	13
1.5 Tujuan Penelitian	13
1.6 Manfaat Penelitian	13
1.7 Ruang Lingkup Penelitian.....	14
1.8 Ringkasan Metodologi Penelitian	14
1.9 Sistematika Penulisan	15
BAB II TINJAUAN PUSTAKA DAN LINGKUP PENELITIAN	17
2.1 Tinjauan Pustaka	17

2.1.1 Pasar Modal.....	17
2.1.2 Saham.....	18
2.1.2.1 Jenis – Jenis Saham.....	19
2.1.2.2 Indeks Harga Saham	21
2.1.3 Investasi	23
2.1.4 <i>Risk and Return</i>	25
2.1.5 <i>Volatility Spillover</i>	28
2.1.6 Pengukuran Volatilitas	29
2.2 Penelitian Terdahulu	30
2.3 Kerangka Pemikiran.....	33
2.4 Hipotesis Penelitian.....	36
BAB III METODOLOGI PENELITIAN	37
3.1 Karakteristik Penelitian.....	37
3.2 Alat Pengumpulan Data	38
3.3 Tahapan Penelitian	38
3.4 Populasi dan Sampel	39
3.5 Pengumpulan Data dan Sumber Data	40
3.6 Teknik Analisis dan Pengujian Hipotesis	40
3.6.1 Uji Akar Unit	41
3.6.2 Uji <i>Augmented Dickey Fuller</i>	42
3.6.3 GARCH (<i>Generalized Autoregressive Conditional Heteroscedastisity</i>)	43
3.6.4 Uji <i>Granger Casuality</i>	45

BAB IV HASIL PENELITIAN DAN PEMBAHASAN.....	47
4.1 Karakteristik Sampel.....	47
4.2 Hasil Penelitian	50
4.2.1 Uji <i>Augmented Dickey Fuller</i>	50
4.2.2 Hasil Perhitungan Volatilitas	58
4.2.3 Uji <i>Granger Casuality</i>	67
4.3 Pembahasan Hasil Penelitian	68
4.3.1 Volatilitas Pasar Saham Indonesia (IHSG).....	68
4.3.2 Volatilitas Pasar Saham Thailand (SET).....	68
4.3.3 <i>Volatility Spillover</i> antara Pasar Saham Indonesia (IHSG) dan Pasar Saham Thailand (SET).....	69
BAB V KESIMPULAN DAN SARAN	73
5.1 Kesimpulan	73
5.2 Saran.....	73
DAFTAR PUSTAKA	75
LAMPIRAN.....	78