

## 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
<b>BAB I PENDAHULUAN .....</b>	<b>1</b>
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
<b>BAB II TINJAUAN PUSTAKA DAN LINGKUP PENELITIAN .....</b>	<b>17</b>
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
<b>BAB III METODOLOGI PENELITIAN .....</b>	<b>37</b>
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

<b>BAB IV HASIL PENELITIAN DAN PEMBAHASAN.....</b>	<b>47</b>
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
<b>BAB V KESIMPULAN DAN SARAN .....</b>	<b>73</b>
5.1 Kesimpulan .....	73
5.2 Saran.....	73
<b>DAFTAR PUSTAKA .....</b>	<b>75</b>
<b>LAMPIRAN.....</b>	<b>78</b>