

## DAFTAR TABEL

Tabel 1.1 Skor Peringkat Prioritas Investasi .....	4
Tabel 1.2 <i>Emerging Market Index</i> Menurut MSCI.....	7
Tabel 3.1 Karakteristik Penelitian.....	37
Tabel 3.2 Variabel Operasional.....	38
Tabel 4.1 Statistik Deskriptif .....	50
Tabel 4.2 Hasil Uji <i>Unit Root</i> ADF IHSG .....	51
Tabel 4.3 Hasil Uji <i>Unit Root</i> ADF Indeks SET.....	52
Tabel 4.4 Hasil Uji <i>Unit Root</i> ADF <i>Return</i> IHSG .....	56
Tabel 4.5 Hasil Uji <i>Unit Root</i> ADF <i>Return</i> Indeks SET .....	57
Tabel 4.6 Hasil Uji Heteroskedastisitas dengan ARCH .....	60
Tabel 4.7 Perbandingan Nilai AIC dan SIC Model – Model ARCH.....	61
Tabel 4.8 Model GARCH .....	62
Tabel 4.9 Hasil Uji <i>Serial Correlation</i> .....	64
Tabel 4.10 Hasil Uji ARCH – LM.....	65
Tabel 4.11 Hasil Uji <i>Granger Casualty</i> .....	67