

## DAFTAR ISI

<b>HALAMAN PENGESAHAN</b> .....	<b>ii</b>
<b>HALAMAN PERNYATAAN</b> .....	<b>iii</b>
<b>KATA PENGANTAR</b> .....	<b>iv</b>
<b>ABSTRAK</b> .....	<b>vi</b>
<b>ABSTRACT</b> .....	<b>vii</b>
<b>DAFTAR ISI</b> .....	<b>viii</b>
<b>DAFTAR TABEL</b> .....	<b>x</b>
<b>DAFTAR GAMBAR</b> .....	<b>xi</b>
<b>BAB I PENDAHULUAN</b> .....	<b>1</b>
1.1    Gambaran Umum Objek Penelitian.....	1
1.2    Latar Belakang Penelitian.....	3
1.3    Perumusan Masalah.....	10
1.4    Tujuan Penelitian.....	11
1.5    Manfaat Penelitian.....	11
1.5.1    Aspek Teoritis .....	11
1.5.2    Aspek Praktis .....	11
1.6    Sistematika Penulisan Tugas Akhir .....	11
<b>BAB II TINJAUAN PUSTAKA</b> .....	<b>13</b>
2.1    Teori dan Penelitian Terdahulu.....	13
2.1.1    Investasi.....	13
2.1.2    Pasar Modal.....	14
2.1.3    Integrasi Pasar modal .....	16
2.1.4    Kointegrasi .....	17
2.1.5    Indeks Harga Saham .....	17
2.1.6    Saham.....	18
2.1.7    Return.....	19
2.1.8    Risiko .....	19
2.1.9    Diversifikasi portofolio .....	20
2.1.10    Penelitian Terdahulu.....	20
2.2    Kerangka Pemikiran .....	32

2.3	Hipotesis Penelitian.....	34
<b>BAB III METODE PENELITIAN .....</b>		<b>35</b>
3.1	Jenis Penelitian.....	35
3.2	Operasional Variabel .....	36
3.3	Tahapan Penelitian.....	37
3.4	Populasi dan Sampel.....	39
3.4.1	Populasi.....	39
3.4.2	Sampel.....	39
3.5	Pengumpulan Data dan Sumber Data.....	40
3.6	Teknik Analisis Data.....	40
3.6.1	Model DCC-GARCH.....	40
<b>BAB IV HASIL PENELITIAN DAN PEMBAHASAN .....</b>		<b>43</b>
4.1	Data Deskriptif .....	43
4.2	Hasil Penelitian.....	45
4.2.1	Grafik Korelasi.....	45
4.2.2	Hubungan Risiko.....	54
4.3	Pembahasan Hasil Penelitian.....	58
<b>BAB V KESIMPULAN DAN SARAN .....</b>		<b>83</b>
5.1	Kesimpulan.....	83
5.2	Saran.....	83
5.2.1	Aspek Teoritis .....	83
5.2.2	Aspek Praktis .....	84
<b>DAFTAR PUSTAKA.....</b>		<b>85</b>
<b>LAMPIRAN.....</b>		<b>93</b>