

## DAFTAR ISI

LEMBAR PERNYATAAN.....	i
KATA PENGANTAR .....	ii
ABSTRAK.....	iii
ABSTRACT.....	iv
UCAPAN TERIMA KASIH .....	v
DAFTAR ISI.....	vii
DAFTAR TABEL.....	x
DAFTAR GAMBAR.....	xii
DAFTAR LAMPIRAN.....	xiii
BAB I. PENDAHULUAN.....	1
1.1 Latar Belakang Penelitian.....	6
1.2 Rumusan Masalah.....	7
1.3 Tujuan Penelitian .....	7
1.4 Kegunaan Penelitian .....	7
BAB II. KAJIAN PUSTAKA.....	8
2.1 Kajian Pustaka .....	8
2.1.1 Konsep Investasi.....	8
2.1.1.1 Pengertian Investasi .....	8
2.1.1.2 Tujuan Investasi.....	9
2.1.1.3 Dasar dan proses Keputusan Investasi.....	9
2.1.2 Konsep Pasar Modal .....	12
2.1.2.1 Pengertian Pasar Modal .....	12
2.1.2.2 Peranan dan Manfaat Pasar Modal .....	14
2.1.2.3 Instrumen Keuangan yang Diperdagangkan di Pasar Modal .....	16
2.1.3 Konsep Saham .....	17
2.1.3.1 Pengertian Saham .....	17
2.1.3.2 Return dan Risiko Saham .....	18
2.1.4 Konsep Volatilitas Harga Saham .....	20
2.1.4.1 Pengertian Volatilitas Harga Saham.....	20

Sulastri, 2016

***VOLATILITAS HARGA SAHAM EMERGING MARKET PADA “EAGLEs COUNTRY”  
(Pengujian Model GARCH terhadap Harga Saham Gabungan Negara Brazil, China, Indonesia,  
Meksiko, Rusia, dan Turki)***

Universitas Pendidikan Indonesia | repository.upi.edu | perpustakaan.upi.edu

2.1.4.2 Pengukuran Volatilitas.....	21
2.1.5 Model ARCH-GARCH .....	22
2.2 Penelitian Terdahulu .....	22
2.3 Kerangka Pemikiran .....	29
<b>BAB III. METODOLOGI PENELITIAN .....</b>	<b>31</b>
3.1 Objek Penelitian .....	31
3.2 Metode Penelitian .....	31
3.3 Operasionalisasi Variabel .....	31
3.4 Jenis dan Sumber Data .....	32
3.5 Populasi dan Sampel.....	32
3.6 Teknik Pengumpulan Data .....	33
3.7 Teknik Analisis Data .....	34
<b>BAB IV. TEMUAN DAN PEMBAHASAN.....</b>	<b>39</b>
4.1 Gambaran Objek Penelitian.....	39
4.1.1 Pergerakan Harga SahamBrazil.....	39
4.1.2 Pergerakan Harga SahamCina.....	40
4.1.3 Pergerakan Harga SahamIndonesia.....	41
4.1.4 Pergerakan Harga SahamMeksiko.....	43
4.1.5 Pergerakan Harga SahamRusia .....	44
4.1.6 Pergerakan Harga SahamTurki.....	45
4.2 Gambaran Return Saham Emerging Market .....	46
4.3 Gambaran Return Saham Emerging Market .....	48
4.3.1 Mean Model Return Saham Emerging Market.....	48
4.3.2 Model Volatilitas Return Saham Emerging Market.....	58
4.3.3 Peramalan Harga Saham Emerging Market .....	67
4.4 Pembahasan .....	79
<b>BAB V. SIMPULAN, IMPLIKASI DAN REKOMENDASI.....</b>	<b>85</b>
5.1 Simpulan.....	85
5.2 Implikasi .....	86
5.3 Rekomendasi .....	86
<b>DAFTAR PUSTAKA .....</b>	<b>88</b>

Sulastrri, 2016

**VOLATILITAS HARGA SAHAM EMERGING MARKET PADA “EAGLEs COUNTRY”**  
*(Pengujian Model GARCH terhadap Harga Saham Gabungan Negara Brazil, China, Indonesia, Meksiko, Rusia, dan Turki)*

Universitas Pendidikan Indonesia | repository.upi.edu | perpustakaan.upi.edu

LAMPIRAN..... 94