

DAFTAR ISI

HALAMAN SAMPUL DEPAN	
HALAMAN SAMPUL BELAKANG	
PERSETUJUAN PEMBIMBING.....	i
HALAMAN PENGESAHAN.....	ii
PERNYATAAN KEASLIAN.....	iii
HALAMAN MOTTO	iv
HALAMAN PERSEMBAHAN.....	v
PRAKATA.....	vi
DAFTAR TABEL.....	viii
DAFTAR GAMBAR	ix
DAFTAR LAMPIRAN.....	x
PEDOMAN TRANSLITERASI	xi
ABSTRAK	xiii
ABSTRACT	xiv
DAFTAR ISI.....	xv
BAB I: PENDAHULUAN	
A. Latar Belakang Masalah.....	1
B. Identifikasi dan Pembatasan Masalah	11
1. Identifikasi Masalah.....	11
2. Pembatasan Masalah	11
C. Rumusan Masalah	12
D. Tujuan Penelitian	13
E. Kegunaan Penelitian.....	13
F. Penegasan Istilah.....	14
1. Penegasan Secara Konseptual	14
2. Penegasan Secara Operasional.....	15
BAB II: LANDASAN TEORI	
A. Saham	16
1. Jenis Saham.....	16

2. Indeks Saham	17
B. <i>Return</i> Saham	19
1. Komponen <i>Return</i> Saham	20
2. Jenis-Jenis <i>Return</i> Saham.....	21
3. Faktor-Faktor yang Mempengaruhi <i>Return</i> Saham.....	22
C. Volatilitas	24
D. <i>Value at Risk</i>	27
E. Penelitian Terdahulu	29
F. Kerangka Pemikiran.....	36
BAB III: METODE PENELITIAN	
A. Rancangan Penelitian	37
B. Sumber Data dan Teknik Pengumpulan Data	40
C. Teknik Analisis Data.....	40
1. <i>Data Time Series</i>	41
2. Perhitungan <i>Return</i> Saham.....	43
3. Uji Stasioneritas	43
4. Model Box-Jenkins	45
5. Prosedur Pembentukan ARMA.....	47
6. Uji ARCH <i>Effect-Lagrange Multiplier</i>	49
7. Model <i>Autoregressive Conditional Heteroskedasticity</i> (ARCH)	49
8. Model <i>Generalized Autoregressive Conditional Heteroscedasticity</i> (GARCH)	50
9. <i>Value at Risk</i>	51
BAB IV: HASIL PENELITIAN	
A. Deskripsi Data.....	52
B. Pengujian Model	56
1. Uji Stasioneritas	56
2. Identifikasi Model AR dan Model MA dengan <i>Correlogram</i> Box- Jenkins.....	57
3. Uji ARCH <i>Effect-Lagrange Multiplier</i>	65
4. Penentuan Model GARCH Terbaik	66

BAB V: PEMBAHASAN

A. Analisis Volatilitas <i>Return</i> Saham LQ45 dan <i>Return</i> Saham Jakarta Islamic Index.....	70
B. Analisis <i>Value at Risk</i>	76

BAB VI: PENUTUP

A. Kesimpulan	78
B. Saran.....	80
DAFTAR RUJUKAN	82
LAMPIRAN	86