

DAFTAR ISI

ABSTRAK	Error! Bookmark not defined.
KATA PENGANTAR	i
DAFTAR ISI.....	iii
DAFTAR TABEL.....	v
DAFTAR GAMBAR	vi
DAFTAR LAMPIRAN.....	vii
BAB I.....	1
PENDAHULUAN	1
1.1 Latar Belakang Masalah	1
1.2 Rumusan Masalah.....	14
1.3 Tujuan Penelitian.....	15
1.4 Manfaat Penelitian.....	15
BAB II.....	17
TELAAH PUSTAKA DAN PERUMUSAN HIPOTESIS	17
2.1 Telaah Pustaka	17
2.2 Perumusan Hipotesis	46
2.3 Kerangka Pemikiran	54
BAB III	57
METODE PENELITIAN.....	57
3.1 Jenis dan Sumber Data	57

3.2	Populasi dan Sampel.....	57
3.3	Teknik Pengumpulan Data	58
3.4	Operasionalisasi Variabel.....	58
3.5	Metode Analisis Data	63
BAB IV		75
HASIL PENELITIAN DAN PEMBAHASAN		75
4.1	Deskripsi Sampel.....	75
4.2	Deskripsi Unit Analisis.....	75
4.3	Uji Asumsi Klasik	79
4.4	Uji Perilaku Data	84
4.5	Uji ARCH <i>Effect</i>	86
4.6	Uji Pemilihan Model Terbaik	87
4.7	Hasil Penelitian.....	97
4.8	Pembahasan	99
4.9	Implikasi Hasil Penelitian.....	106
BAB V.....		109
KESIMPULAN DAN SARAN.....		109
5.1	Kesimpulan.....	109
5.2	Saran	110
DAFTAR PUSTAKA		112
LAMPIRAN.....		124

DAFTAR TABEL

Tabel 2.1 Matriks Review Penelitian Terdahulu.....	40
Tabel 4.1 Analisis Deskriptif Masing-Masing Variabel	76
Tabel 4.2 Hasil Uji Multikolinearitas	81
Tabel 4.3 Hasil Uji <i>Lagrange Multiplier (LM Test)</i>	82
Tabel 4.4 Hasil Uji Heteroskedastisitas	83
Tabel 4.5 Hasil Uji <i>Augmented Dickey-Fuller Test</i> pada Tingkat Level.....	85
Tabel 4.6 Hasil Uji <i>Augmented Dickey-Fuller Test</i> pada Tingkat <i>First Difference</i>	85
Tabel 4.7 Hasil Uji ARCH <i>Effect</i>	86
Tabel 4.8 Hasil Uji ARCH (1,0)	88
Tabel 4.9 Hasil Uji ARCH (2,0)	89
Tabel 4.10 Hasil Uji GARCH (1,1)	90
Tabel 4.11 Hasil Uji GARCH (2,1)	92
Tabel 4.12 Hasil Uji GARCH (2,2)	93
Tabel 4.13 Hasil Uji Alternatif Model ARCH/GARCH.....	94
Tabel 4.14 Hasil Uji ARCH-LM (Verifikasi Model).....	96
Tabel 4.15 Model Terpilih (GARCH (2,1)).....	97

DAFTAR GAMBAR

Gambar 1.1 Pergerakan Indeks Saham <i>Mining</i> Selama Tahun 2019.....	4
Gambar 2.1 Kerangka Pemikiran.....	55
Gambar 4.1 Hasil Uji Normalitas Data.....	80

DAFTAR LAMPIRAN

Lampiran 1 Daftar Perusahaan Sektor Pertambangan	124
Lampiran 2 Uji Asumsi Klasik	125
Lampiran 3 Uji Perilaku Data	127
Lampiran 4 Uji ARCH <i>Effect</i>	130
Lampiran 5 Uji Pemilihan Model Terbaik	131
Lampiran 6 Verifikasi Model (Uji ARCH-LM)	134