

DAFTAR ISI

HALAMAN JUDUL.....

HALAMAN PENGESAHAN..... i

PERNYATAAN ORISINALITAS SKRIPSI ii

KATA PENGANTAR iv

ABSTRAK v

ABSTRACT vi

DAFTAR ISI..... vii

DAFTAR TABEL..... viii

DAFTAR GAMBAR viii

DAFTAR LAMPIRAN..... ix

1. PENDAHULUAN

2. TINJAUAN PUSTAKA

2.1 Landasan Teori..... 8

2.2 Penelitian Sebelumnya 13

2.3 Hipotesis..... 18

3. METODE PENELITIAN

3.1 Pendekatan Penelitian 21

3.2 Model Empiris..... 21

3.3 Definisi Operasional Variabel..... 22

3.4 Jenis dan Sumber Data 23

3.5 Teknik Analisis 24

4. HASIL DAN PEMBAHASAN

4.1 Deskriptif Statistik Variabel..... 26

4.2 Intepretasi Hasil dan Pembahasan..... 37

4.3 Diskusi 33

5. KESIMPULAN DAN SARAN

5.1 Kesimpulan 34

5.2 Saran..... 34

DAFTAR PUSTAKA

DAFTAR TABEL

- Tabel 4.1 Statistik Deskriptif
- Tabel 4.2 Hasil Uji OLS
- Tabel 4.3 Hasil Uji Granger Casulaty
- Tabel 4.4 Hasil Uji ADF
- Tabel 4.5 Hasil Uji ADF di First Difference
- Tabel 4.6 Hasil Uji Serial Correlation
- Tabel 4.7 Hasil Uji Heteroscedascity
- Tabel 4.8 Hasil Uji Normalitas

DAFTAR GAMBAR

- Gambar 2.1 Kerangka Berpikir
- Gambar 4.2 Histogram data Amerika Serikat
- Gambar 4.3 Histogram data Indonesia

DAFTAR LAMPIRAN

- Lampiran 1 : Perusahaan dalam indeks INFOBANK15
- Lampiran 2 : Perusahaan dalam indeks DJUSBK
- Lampiran 3 : Output OLS
- Lampiran 4 : Output Granger Casualty