

## DAFTAR ISI

HALAMAN JUDUL .....	i
SERTIFIKASI .....	ii
PENGESAHAN TESIS.....	iii
<i>ABSTRACT</i> .....	iv
ABSTRAK .....	v
KATA PENGANTAR.....	vi
DAFTAR ISI.....	viii
DAFTAR TABEL .....	xi
DAFTAR GAMBAR.....	xii
<b>BAB I PENDAHULUAN.....</b>	<b>1</b>
1.1. <b>Latar Belakang Masalah .....</b>	<b>1</b>
1.2. <b>Rumusan Masalah.....</b>	<b>9</b>
1.3. <b>Tujuan Penelitian .....</b>	<b>11</b>
1.4. <b>Manfaat Penelitian .....</b>	<b>11</b>
1.5. <b>Sistematika Penulisan .....</b>	<b>12</b>
<b>BAB II TINJAUAN PUSTAKA.....</b>	<b>14</b>
2.1. <b>Landasan Teori.....</b>	<b>14</b>
2.1.1. <b>Investasi.....</b>	<b>14</b>
2.1.2. <b>Pasar Modal.....</b>	<b>15</b>
2.1.3. <b><i>Return</i> Pasar .....</b>	<b>16</b>
2.1.4. <b>Instrumen Pasar Modal di Indonesia.....</b>	<b>17</b>
2.1.5. <b>Harga Saham .....</b>	<b>21</b>
2.1.6. <b>Analisis Harga Saham .....</b>	<b>21</b>
2.1.7. <b>Indeks Harga Saham Gabungan (IHSG).....</b>	<b>22</b>
2.1.8. <b>Harga Minyak Dunia .....</b>	<b>23</b>
2.1.9. <b><i>Dow Jones Industrial Average</i> (DJIA).....</b>	<b>28</b>
2.1.10. <b>Hubungan Harga Minyak Dunia dan <i>Return</i> Pasar Saham .....</b>	<b>30</b>

2.2.	Penelitian Terdahulu .....	32
2.3.	Pengaruh antar Variabel dan Rumusan Hipotesis .....	39
2.3.1.	Pengaruh Harga Minyak Dunia terhadap IHSG .....	39
2.3.2.	Pengaruh Harga Minyak Dunia terhadap Indeks Dow Jones..	40
2.3.3.	Pengaruh Indeks Dow Jones terhadap IHSG.....	41
2.3.4.	Hubungan antara IHSG dan Pandemi Covid-19 .....	42
2.4.	Hipotesis Penelitian .....	43
2.5.	Kerangka Pemikiran.....	44
 <b>BAB III METODOLOGI PENELITIAN .....</b>		<b>45</b>
3.1.	Variabel Penelitian dan Definisi Operasional Variabel.....	45
3.1.1.	Variabel Dependen.....	45
3.1.2.	Variabel Independen.....	46
3.1.3.	Variabel Intervening.....	47
3.1.4.	Variabel Kontrol .....	47
3.1.5.	<i>Average Volatility Index (RV)</i> .....	48
3.1.6.	<i>Return IHSG saat t-1</i> .....	48
3.2.	Poulasi dan Sampel .....	51
3.2.1.	Populasi Penelitian .....	51
3.2.2.	Sampel Penelitian .....	51
3.3.	Jenis dan Sumber Data .....	52
3.4.	Metode Pengumpulan Data .....	52
3.5.	Metode Analisis .....	52
3.5.1.	Uji Statistik Deskriptif.....	52
3.5.2.	<i>Autoregressive Orde 1</i> .....	53
3.5.3.	Uji Normalitas .....	53
3.5.4.	Uji Stasioneritas .....	53
3.5.5.	Uji Regresi.....	54
3.5.6.	Uji Signifikansi Koefisien .....	57
3.5.7.	Uji Beda.....	57

<b>BAB IV HASIL PENELITIAN.....</b>	<b>59</b>
<b>4.1.    Deskripsi Objek Penelitian.....</b>	<b>59</b>
<b>4.1.1.    Gambaran Umum Objek Penelitian.....</b>	<b>59</b>
<b>4.1.2.    Deskripsi Data Penelitian .....</b>	<b>59</b>
<b>4.1.3.    Autoregressive Orde 1 .....</b>	<b>61</b>
<b>4.1.4.    Uji Normalitas .....</b>	<b>62</b>
<b>4.1.5.    Uji Stasioneritas .....</b>	<b>62</b>
<b>4.2.    Hasil Analisis Regresi.....</b>	<b>63</b>
<b>4.2.1.    Analisis Regresi OLS dan FGLS .....</b>	<b>63</b>
<b>4.2.2.    Uji Regresi dengan Variabel Intervening .....</b>	<b>67</b>
<b>4.2.3.    Uji Beda.....</b>	<b>69</b>
<b>4.3.    Pembahasan .....</b>	<b>69</b>
<b>BAB V PENUTUP .....</b>	<b>76</b>
<b>5.1.    Kesimpulan Masalah Penelitian .....</b>	<b>76</b>
<b>5.2.    Implikasi Teoritis .....</b>	<b>77</b>
<b>5.3.    Implikasi Manajerial.....</b>	<b>80</b>
<b>5.4.    Keterbatasan Penelitian.....</b>	<b>81</b>
<b>5.5.    Saran untuk Penelitian Mendatang.....</b>	<b>82</b>
<b>DAFTAR PUSTAKA .....</b>	<b>83</b>
<b>LAMPIRAN.....</b>	<b>90</b>