

DAFTAR ISI

	Halaman
Sertifikasi	ii
Halaman Persetujuan Draft Tesis.....	iii
Abstrak	iv
Kata Pengantar	vi
Daftar Isi.....	viii
Daftar Tabel	xi
Daftar Gambar.....	xiii
Daftar Skema.....	xiv
Daftar Grafik	xv
BAB I PENDAHULUAN	
1.1 Latar Belakang	1
1.2 Rumusan Masalah	12
1.3 Tujuan Penelitian.....	14
1.4 Manfaat Penelitian.....	14
1.5 Sistematika Penulisan.....	15
BAB II TELAAH PUSTAKA & PENGEMBANGAN MODEL	
2.1 Telaah Pustaka.....	17
2.1.1. Pasar Modal.....	17
2.1.2. Integrasi Pasar Modal.....	20
2.1.3. Kointegrasi	24
2.1.4. Krisis Moneter di Amerika Serikat	25
2.1.5. Bursa Efek indonesia.....	28
2.1.6. Indeks Harga Saham Gabungan (IHSG)	29
2.1.7. Dow Jones Industrial Average (DJIA)	31
2.1.8. Financial Times Stock Exchange (FTSE 100)	32
2.1.9. IBEX 35.....	33
2.1.10. ATHEX	34

2.2	Penelitian Terdahulu.....	35
2.3	Kerangka Pemikiran Teori	50
2.4	Hipotesis	76
BAB III	METODE PENELITIAN	
3.1	Jenis dan Sumber Data	78
3.2	Populasi dan Sampel	78
3.3	Variabel Penelitian dan Definisi Operasional	79
3.4	Metode Pengumpulan Data	82
3.5	Metode Analisis Johansen Cointegration Test	82
3.5.1.	<i>Unit Root Test</i> dengan <i>Augmented</i>	
	Dickey-Fuller (ADF) <i>Test</i>	84
3.5.2.	<i>Granger Causality Test</i>	86
3.5.3.	Langkah-langkah Teknik Analisis.....	88
BAB IV	ANALISA DAN PEMBAHASAN	
4.1	Deskripsi Obyek Penelitian	91
4.2	Deskripsi Variabel	94
4.2.1	Indeks Harga Saham Gabungan (IHSG)	94
4.2.2	Dow Jones Industrial Average (DJIA)	95
4.2.3	Financial Times Stock Exchange (FTSE 100)	95
4.2.4	IBEX 35.....	96
4.2.5	ATHEX	96
4.2.6	Statistika Deskriptif	96
4.3	Analisis Data dan Pembahasan.....	98
4.3.1	Granger Causality Test.....	98
4.3.2	Augmented Dickey-Fuller (ADF) <i>Test</i> pada level	

Series terhadap residual uji regresi sederhana.....	102
4.3.3 Johansen Cointegration Test	105
4.3.3.1 Unit root test dengan Augmented Dickey-Fuller (ADF) Test.....	106
4.3.3.2 Johansen Cointegration Test untuk Menjawab hipotesis 5	116
BAB V PENUTUP	
5.1 Simpulan.....	119
5.2 Implikasi Teoritis	120
5.3 Implikasi Manajerial.....	123
5.4 Keterbatasan Penelitian	124
5.5 Agenda Penelitian Mendatang.....	125

DAFTAR PUSTAKA