

DAFTAR ISI

	Halaman
HALAMAN PERSETUJUAN.....	ii
PENGESAHAN KELULUSAN UJIAN.....	iii
PERNYATAAN ORISINALITAS SKRIPSI	iv
ABSTRAK	v
<i>ABSTRACT</i>	vi
KATA PENGANTAR	vii
DAFTAR ISI.....	x
DAFTAR TABEL.....	xiii
DAFTAR GAMBAR	xiv
BAB I.....	1
1.1. Latar Belakang Masalah	1
1.2. Rumusan Permasalahan	6
1.3. Tujuan dan Kegunaan Penelitian	6
1.3.1. Tujuan Penelitian	6
1.3.2. Kegunaan Penelitian	6
1.4. Sistematika Penulisan	7
BAB II.....	8
2.1. Landasan Teori dan Penelitian Terdahulu	8
2.1.1. Teori Portofolio.....	8
2.1.2. Harga Minyak Mentah Dunia	10
2.1.3. Indeks Harga Saham Gabungan.....	14
2.1.4. Penelitian Terdahulu	16
2.2. Kerangka Pemikiran	18
2.3. Hipotesis	20
BAB III	24
3.1. Variabel Penelitian dan Definisi Operasional Variabel.....	24
3.1.1. Variabel Dependen : <i>Return</i> Indeks Harga Saham Gabungan	24
3.1.2. Variabel Independen : <i>Return</i> Harga Minyak Mentah Dunia	25
3.2. Populasi dan Sampel.....	25

3.2.1. Populasi.....	25
3.2.2. Sampel.....	26
3.3. Jenis dan Sumber Data.....	27
3.4. Metode Pengumpulan Data.....	27
3.5. Metode Analisis	28
3.5.1. Analisis Statistik deskriptif	28
3.5.2. Uji Stasioneritas	28
3.5.3. Penentuan <i>Lag Length</i>	29
3.5.4. Analisis <i>Vector Autoregressive</i> (VAR).....	30
3.5.4.1 Analisis <i>Impulse Response</i>	31
3.5.4.2 Analisis <i>Variance Decomposition</i>	31
3.6. Bagan Metode Analisis	32
BAB IV	33
4.1. Deskripsi Objek Penelitian	33
4.2. Analisis Data.....	34
4.2.1. Statistik Deskriptif.....	34
4.2.2. Uji Stasioneritas	37
4.2.3. Penentuan <i>Lag Length</i>	39
4.2.4. Analisis <i>Vector Autoregressive</i> (VAR)	40
4.2.4.1. Analisis <i>Impulse Response</i>	41
4.2.4.2 Analisis <i>Variance Decomposition</i>	48
4.3. Interpretasi Hasil.....	56
4.3.1. Korelasi antara <i>Return</i> Minyak Brent dan <i>Return</i> Indeks Harga Saham Gabungan Indonesia.	57
4.3.2. Korelasi antara <i>Return</i> Minyak Brent dan <i>Return</i> Indeks Harga Saham Gabungan Malaysia.	58
4.3.3. Korelasi antara <i>Return</i> Minyak Brent dan <i>Return</i> Indeks Harga Saham Gabungan Thailand.	60
4.3.4. Korelasi antara <i>Return</i> Minyak Brent dan <i>Return</i> Indeks Harga Saham Gabungan Singapura.	62
4.3.5. Korelasi antara <i>Return</i> Minyak Brent dan <i>Return</i> Indeks Harga Saham Gabungan Filipina.	64
4.3.6. Korelasi antara <i>Return</i> Minyak Brent dan <i>Return</i> Indeks Harga Saham	

Gabungan Vietnam.....	66
BAB V.....	68
5.1. Kesimpulan.....	68
5.2. Keterbatasan	70
5.3. Saran	70
DAFTAR PUSTAKA	72
DAFTAR LAMPIRAN.....	74