

DAFTAR ISI

HALAMAN JUDUL	i
SERTIFIKASI	ii
PERSETUJUAN REVISI TESIS	iii
ABSTRACT	iv
ABSTRAK	v
KATA PENGANTAR	vi
DAFTAR TABEL	x
DAFTAR GAMBAR	xii
DAFTAR RUMUS	xiii
DAFTAR LAMPIRAN	xiv
BAB I PENDAHULUAN	
1.1 Latar Belakang Masalah.....	1
1.2 Perumusan Masalah.....	8
1.3 Tujuan dan Kegunaan Penelitian.....	9
BAB II TELAAH PUSTAKA DAN HIPOTESIS	
2.1 Telaah Pustaka.....	11
2.2 Penelitian terdahulu.....	41
2.3 Kerangka Pemikiran Teoritis.....	46
2.4 Perumusan Hipotesis.....	48
BAB III METODE PENELITIAN	
3.1 Jenis dan Sumber Data.....	50
3.2 Populasi dan Sampel.....	51
3.3 Metode Pengumpulan Data.....	52

3.4 Definisi Operasional Variabel.....	52
3.5 Teknik Analisis.....	55

BAB IV HASIL DAN PEMBAHASAN

4.1 Gambaran Umum dan Deskripsi Statistik Objek Penelitian.....	62
4.2 Pengujian Hipotesis.....	64
4.3 Pembahasan Hasil Uji Hipotesis.....	73

BAB V KESIMPULAN DAN IMPLIKASI KEBIJAKAN

5.1 Kesimpulan.....	78
5.2 Implikasi Teoritis.....	79
5.3 Implikasi Manajerial.....	79
5.4 Keterbatasan Penelitian.....	80
5.5 Agenda Penelitian Selanjutnya.....	80

DAFTAR PUSTAKA

LAMPIRAN

DAFTAR TABEL

Tabel 1.1 Tahun Liberalisasi Pasar Modal Negara ASEAN-5.....	2
Tabel 1.2 Riset Gap.....	7
Tabel 2.1 Perbandingan Koefisien Korelasi Antara Beberapa Pasar Saham Selama 2 Periode Waktu.....	21
Tabel 2.2 Dampak Pelaksanaan Protokol Kyoto Bagi Negara-Negara Pengekspor Minyak.....	32
Tabel 2.3 Penelitian Terdahulu.....	45
Tabel 3.1 Sampel Penelitian.....	52
Tabel 3.2 Definisi Operasional Variabel.....	54
Tabel 4.1 Deskriptif Statistik Indeks Pasar Modal ASEAN-5 Periode 3 Maret 2001- 2 Maret 2005.....	63
Tabel 4.2 Deskriptif Statistik Indeks Pasar Modal ASEAN-5 Periode 4 Maret 2005 – 4 Maret 2009.....	64
Tabel 4.3 Probabilitas hasil pengujian ADF dan PP.....	65
Tabel 4.4 Hasil Uji ADF Residual RJCI-RFBMKLCI.....	66
Tabel 4.5 Hasil Uji ADF Residual RJCI-RFSSTII.....	66
Tabel 4.6 Hasil Uji ADF Residual RJCI-RSET.....	67
Tabel 4.7 Hasil Uji ADF Residual RJCI-RPCOMP.....	67
Tabel 4.8 Penentuan Panjang Lag Optimal VAR Indeks Pasar Modal ASEAN-5 Periode 3 Maret 2001 – 2 Maret 2005.....	68

Tabel 4.9 Hasil Pengujian Kausalitas Granger Indeks Pasar Modal Indonesia- ASEAN-5 periode 3 Maret 2001 – 2 Maret 2005.....	71
Tabel 4.10 Hasil Pengujian Kausalitas Granger Indeks Pasar Modal Indonesia- ASEAN-5 Periode 4 Maret 2005 – 4 Maret 2009.....	72