

Daftar Isi

Halaman Judul	i
Halaman Pengesahan	ii
<i>Abstract</i>	iii
Abstrak	iv
Kata Pengantar	v
Daftar Tabel	x
Daftar Gambar	xi
Daftar Rumus	xii
Bab I Pendahuluan	1
1.1 Latar Belakang Masalah	1
1.2 Perumusan Masalah	14
1.3 Tujuan Penelitian	16
1.4 Kegunaan Penelitian	17
Bab II Telaah Pustaka dan Pengembangan Model	18
2.1 Telaah Pustaka	18
2.1.1 <i>Contagion Theory</i>	18
2.1.2 Kredit Subprima (<i>Subprime Mortgage</i>)	21
2.1.3 Pasar Modal	22
2.1.4 Pasar Modal Amerika Serikat	24
2.1.5 Pasar Modal Jepang	25
2.1.6 Pasar Modal China	26

	2.1.7	Pasar Modal Indonesia	27
	2.1.8	Pasar Modal India	28
	2.2	Penelitian Terdahulu	29
	2.3	Kerangka Pemikiran Teoritis	37
	2.3.1	Hubungan DJIA dengan Nikkei 225 (Jepang)	38
	2.3.2	Hubungan DJIA dengan SSEK (China)	39
	2.3.3	Hubungan DJIA dengan IHSG (Indonesia)	40
	2.3.4	Hubungan DJIA dengan BSSE (India)	42
	2.4	Perumusan Hipotesis	44
Bab III		Metode Penelitian	47
	3.1	Jenis dan Sumber Data	47
	3.2	Populasi dan Sampel	48
	3.3	Metode Pengumpulan Data	52
	3.4	Teknik Analisis	52
	3.4.1	Uji Stasioneritas Data dan Derajat Integrasi	57
	3.4.2	Penentuan <i>Lag Length</i>	58
	3.4.3	Uji Kausalitas Granger	59
	3.4.4	Uji Kointegrasi	61
	3.4.5	Estimasi VAR	62
	3.4.6	<i>Impuls Response Function</i> (IRF)	63
	3.4.7	<i>Variance Decomposition</i>	63
Bab IV		Pembahasan dan Hasil Penelitian	65
	4.1	Perkembangan dan Strategi Antisipasi Dampak Krisis Global ...	65

4.2	Statistika Deskriptif Variabel-Variabel yang Digunakan.....	69
4.3	Uji Asumsi Klasik	71
4.3.1	Uji Normalitas	72
4.3.2	Uji Heteroskedastisitas	73
4.3.3	Uji Multikolinearitas	75
4.4	Hasil Analisis	78
4.4.1	Uji Stasioneritas Data dan Derajat Integrasi	78
4.4.2	Penentuan <i>Lag Length</i>	81
4.4.3	Uji Kausalitas Granger	83
4.4.4	Uji Kointegrasi	87
4.4.5	Estimasi VAR	89
4.4.6	<i>Impuls Response Function (IRF)</i>	93
4.4.7	<i>Variance Decomposition (IRF)</i>	95
Bab V	Kesimpulan dan Implikasi	100
5.1	Kesimpulan	100
5.2	Implikasi Teoritis	108
5.3	Implikasi Manajerial	110
5.4	Keterbatasan Penelitian	111
5.5	Agenda Penelitian Mendatang	111
	Daftar Referensi	113