

## DAFTAR ISI

<b>SURAT PERNYATAAN KEASLIAN.....</b>	<b>iv</b>
<b>MOTTO .....</b>	<b>v</b>
<b>KATA PENGANTAR.....</b>	<b>vi</b>
<b>HALAMAN PERSEMBAHAN .....</b>	<b>viii</b>
<b>INTI SARI .....</b>	<b>x</b>
<b>ABSTRACT .....</b>	<b>xi</b>
<b>DAFTAR ISI.....</b>	<b>xii</b>
<b>DAFTAR TABEL .....</b>	<b>xv</b>
<b>DAFTAR GAMBAR .....</b>	<b>xvi</b>
<b>DAFTAR GRAFIK .....</b>	<b>xvii</b>
<b>DAFTAR LAMPIRAN .....</b>	<b>xviii</b>
<b>BAB I PENDAHULUAN.....</b>	<b>1</b>
1.1. Latar Belakang.....	1
1.2. Rumusan Masalah.....	7
1.3. Tujuan Penelitian.....	8
1.4. Manfaat Penelitian.....	8
1.5. Keaslian Penelitian.....	9
<b>BAB II TINJAUAN PUSTAKA .....</b>	<b>13</b>
2.1. Landasan Teori.....	13
2.1.1. Teori Permintaan Aset.....	13
2.1.2. <i>Efficient Market Hypothesis</i> (EMH) .....	14
2.1.3. Indeks Harga Saham Gabungan.....	15
2.1.4. Suku Bunga.....	16
2.1.5. Pengaruh Suku Bunga Terhadap Indeks Harga Saham Gabungan .....	17
2.1.6. Nilai Impor Barang Modal.....	18
2.1.7. Pengaruh Nilai Impor Barang Modal Terhadap Indeks Harga Saham Gabungan. ....	18
2.1.8. Harga Minyak Mentah .....	19
2.1.9. Pengaruh Harga Minyak Mentah terhadap Indeks Harga Saham Gabungan .....	20
2.2. Penelitian Terdahulu.....	21

2.3. Kerangka Pemikiran Konseptual.....	23
2.4. Hipotesis.....	25
<b>BAB III METODE PENELITIAN .....</b>	<b>27</b>
3.1. Jenis Penelitian.....	27
3.2. Data dan Sumber Data.....	27
3.3. Definisi Operasional Variabel.....	27
3.4. Alat Analisis.....	29
3.4.1. Uji Stasioneritas .....	30
3.4.2. Uji Penentu Panjang Lag Optimum .....	30
3.4.3. Uji Stabilitas Model VAR .....	31
3.4.4. Uji Kointegrasi Johansen .....	31
3.4.5. Model VECM.....	32
3.4.6. Analisis <i>Impulse Response Function</i> .....	33
3.4.7. <i>Variance Decomposite</i> .....	34
<b>BAB IV HASIL DAN PEMBAHASAN .....</b>	<b>35</b>
4.1. Deskripsi Data Penelitian.....	35
4.1.1. Indeks Harga Saham Gabungan .....	35
4.1.2. Suku Bunga .....	37
4.1.3. Nilai Impor Barang Modal .....	38
4.1.4. Harga Minyak Mentah .....	39
4.2. Analisis Data.....	41
4.2.1. Uji Stasinoer.....	41
4.2.2. Uji Lag Optimum .....	42
4.2.3. Uji Stabilitas Model .....	43
4.2.4. Uji Kointegrasi .....	44
4.2.5. Analisis <i>Impulse Response Function</i> .....	45
4.2.6. ....	47
4.3. Pembahasan.....	49
4.3.1. Respon Indeks Harga Saham Gabungan Terhadap Suku Bunga .....	49
4.3.2. Respon Indeks Harga Saham Gabungan Terhadap Nilai Impor Barang Modal .....	50
4.3.3. Respon Indeks Harga Saham Gabungan Terhadap Harga Minyak Mentah Dunia .....	51

<b>BAB V KESIMPULAN DAN SARAN .....</b>	<b>53</b>
5.1.Kesimpulan.....	53
5.2.Saran.....	54
<b>LAMPIRAN.....</b>	<b>57</b>
<b>DAFTAR PUSTAKA.....</b>	<b>64</b>