

DAFTAR ISI

DAFTAR TABEL	
DAFTAR GAMBAR	
DAFTAR LAMPIRAN	
1 PENDAHULUAN	1
Latar Belakang	1
Perumusan Masalah	3
Tujuan Penelitian	4
Manfaat Penelitian	4
Ruang Lingkup Penelitian	4
2 TINJAUAN PUSTAKA	5
Kerangka Teoritis	5
Pasar Modal	5
Indeks Harga Saham Gabungan (IHSG)	6
Indeks Sektoral	7
Kajian Penelitian Terdahulu	13
3 METODE	19
Jenis dan Sumber Data	19
Teknik Pengumpulan Data dan Informasi	20
Teknik Pengolahan Data dan Analisis Data	20
Metode Analisis Data	20
4 GAMBARAN UMUM	26
5 HASIL DAN PEMBAHASAN	35
6 SIMPULAN DAN SARAN	53
Simpulan	53
Saran	54
DAFTAR PUSTAKA	54
RIWAYAT HIDUP	58



© Hak Cipta Milik IPB
Hak Cipta Dilindungi Undang-Undang
Dilarang mengutip sebagian atau seluruh karya tulis ini tanpa mencantumkan atau menyebutkan sumbernya. Pengutipan hanya untuk kepentingan pendidikan, penelitian, penulisan karya ilmiah, penyusunan laporan, penulisan kritik, atau tinjauan suatu masalah; dan pengutipan tersebut tidak merugikan kepentingan IPB. Dilarang mengumunkan dan memperbanyak sebagian atau seluruh karya tulis ini dalam bentuk apa pun tanpa izin IPB.

DAFTAR TABEL

1. Ringkasan penelitian terdahulu	14
2. Jenis dan sumber data	19
3. Hasil statistik deskriptif harga saham IHSG dan indeks sektoral	28
4. Hasil analisis deskriptif variabel makroekonomi	28
5. Ringkasan hasil uji stasioneritas data	35
6. Ringkasan uji stabilitas	36
7. Ringkasan uji lag optimum return indeks IHSG dan indeks sektoral terhadap variabel makroekonomi	36
8. Hasil Model Structural VAR	38

DAFTAR GAMBAR

1. Volume perdagangan saham pada tahun 2007- 2014 di Indonesia	1
2. <i>Return</i> saham periode 2006-2014 di Indonesia	2
3. Kerangka pemikiran penelitian	18
4. Kerangka teknik pengolahan dan analisis data	20
5. Pergerakan harga emas pada periode 2000-2014	29
6. Pergerakan harga emas pada periode 2000-2014	30
7. Pergerakan IHK periode 2000-2014	30
8. Pergerakan utang pemerintah periode 2000-2014	31
9. Pergerakans jumlah uang beredar periode 2000-2014	32
10. Pergerakan tingkat suku bunga beredar periode 2000-2014	32
11. Pergerakan nilai tukar periode 2000-2014	33
12. Pergerakan utang pemerintah	34
13. Pergerakan neraca perdagangan pada periode 2000-2014	34
14. Pengaruh guncanganharga minyak terhadap <i>return</i> saham IHSG dan indeks sektoral	42
15. Pengaruh guncanganharga emas terhadap <i>return</i> saham IHSG dan indeks sektoral	44
16. Pengaruh guncangan suku bunga terhadap <i>return</i> saham IHSG dan indeks sektoral	46
17. Pengaruh guncangan nilai tukar terhadap <i>return</i> saham IHSG dan indeks sektoral	48
18. Hasil analisis FEVD pada <i>return</i> saham IHSG	49
19. Hasil analisis FEVD pada <i>return</i> saham indeks sektoral	50