

DAFTAR ISI

HALAMAN PENGESAHAN.....	3
HALAMAN PERNYATAAN	4
KATA PENGANTAR	5
DAFTAR ISI.....	7
DAFTAR TABEL.....	9
DAFTAR GAMBAR	10
DAFTAR LAMPIRAN.....	11
DAFTAR ARTI LAMBANG DAN SINGKATAN	12
ABSTRAK	13
ABSTRACT.....	14
BAB I <u>P</u> ENDAHULUAN.....	15
1.1 Latar Belakang.....	15
1.2 Rumusan Masalah	19
1.3 Pertanyaan Penelitian	24
1.4 Tujuan Penelitian.....	24
1.5 Manfaat Penelitian.....	25
1.6 Ruang Lingkup dan Batasan Penelitian.....	25
1.7 Sistematika Penulisan Penelitian.....	26
BAB II <u>L</u> ANDASAN TEORI DAN TINJAUAN PUSTAKA	28
2.1 <i>Asymmetric Information</i>	28
2.1.1 <i>Asymmetric Information</i> menyebabkan <i>Herding Behavior</i>	29
2.2 <i>Efficient Market Hypothesis</i>	30
2.3 Interdependence.....	31
2.4 Spillover	33

2.4.1 <i>Mean Spillover</i>	33
2.4.2 <i>Volatility Spillover</i>	34
2.5 Tinjauan Pustaka	37
2.6 Pengembangan Hipotesis.....	39
BAB III METODE PENELITIAN	42
3.1 Desain Penelitian	42
3.2 Variabel Penelitian dan Definisi Operasional Variabel.....	43
3.2.1 Variabel Penelitian.....	43
3.2.2 Definisi Operasional Variabel	43
3.3 Populasi dan Sampel.....	45
3.4 Data dan Teknik Pengumpulan Data.....	47
3.5 Teknik Analisis Data	48
BAB IV HASIL PENELITIAN DAN PEMBAHASAN	51
4.1 Deskripsi Data	51
4.2 Hasil Analisis Data dan Pengujian Hipotesis	52
4.3 Pembahasan	69
BAB V PENUTUP	73
5.1 Kesimpulan.....	73
5.2 Saran	75
DAFTAR PUSTAKA	76
LAMPIRAN	79