

Daftar Isi

Kata Pengantar	iv
Daftar Isi	vii
Daftar Tabel.....	ix
Daftar Gambar	x
Daftar Lampiran	xi
Intisari.....	xii
Abstract.....	xiii
BAB I PENDAHULUAN.....	1
1.1. Latar Belakang	1
1.2. Rumusan Masalah	3
1.3. Pertanyaan Penelitian	4
1.4. Tujuan Penelitian	5
1.5. Motivasi Penelitian	5
1.6. Manfaat Penelitian	6
1.7. Kontribusi Penelitian.....	6
1.8. Ruang Lingkup dan Batasan Penelitian	7
1.9. Sistematika Penulisan	7
BAB II LANDASAN TEORI	9
2.1 Landasan Teori.....	9
2.1.1 Teori Kebijakan Belanja Pemerintah	9
2.1.1.1 Teori Keynesian: <i>The General Theory of Employment, Interest, and Money</i>	10
2.1.2 Model IS-LM	12
2.1.3 Mundell-Flemming	14
2.2 Konsep <i>Efficient Market Hypotheses</i>	17
2.3 Volatilitas Harga Saham	21
2.4 Mekanisme Transmisi Kebijakan.....	24
2.5 Tinjauan Pustaka	25
BAB III METODOLOGI PENELITIAN	33
3.1. Desain Penelitian.....	33

3.2.	Definisi Operasional Variabel.....	34
3.3.	Populasi dan Sampel	38
3.4.	Instrumen Penelitian	38
3.5.	Teknik Pengumpulan Data.....	39
3.6.	Teknik Analisis Data.....	39
3.6.1.	Prosedur Pembersihan Data	39
3.6.2.	Pengujian <i>Unit Root</i>	40
3.6.3.	Uji Heteroskedastisitas.....	43
3.6.4.	Estimasi Model GARCH	45
3.6.5.	Estimasi Model GARCHX.....	47
BAB IV HASIL PENELITIAN DAN PEMBAHASAN.....		52
4.1.	Statistik Deskriptif	52
4.2.	Hasil Analisis	54
4.2.1.	Pengujian <i>Seasonality</i>	54
4.2.2.	Pengujian <i>Unit Root</i>	54
4.2.3.	Hasil Estimasi Model GARCH.....	61
4.2.4.	Hasil Estimasi Model EGARCH.....	65
4.3.	Pembahasan.....	68
BAB V KESIMPULAN		74
5.1.	Kesimpulan	74
5.2.	Implikasi.....	76
5.3.	Limitasi	77
Daftar Pustaka.....		79
Lampiran		83