

Daftar Isi

Halaman Judul.....	i
Halaman Pengesahan	ii
Halaman Pernyataan Bebas Plagiasi	iii
Kata Pengantar	iv
Daftar Isi.....	vi
Daftar Tabel.....	viii
Daftar Gambar.....	ix
Daftar Lampiran	x
Intisari	xi
Abstract	xii
BAB I PENDAHULUAN	1
1.1 Latar Belakang	1
1.2 Rumusan Masalah	4
1.3 Pertanyaan Penelitian	5
1.4 Tujuan Penelitian.....	5
1.5 Motivasi Penelitian	6
1.6 Manfaat Penelitian	7
1.7 Kontribusi Penelitian.....	7
1.8 Ruang Lingkup dan Batasan Penelitian	8
1.9 Sistematika Penelitian	8
BAB II LANDASAN TEORI DAN TINJAUAN PUSTAKA	10
2.1 Landasan Teori	10
2.1.1 Pasar Saham	10
2.1.2 Teori Nilai Tukar	11
2.1.3 Hubungan Nilai Tukar dan Kinerja Pasar Saham	12
2.1.4 Non-linearitas dan Model TAR.....	15

2.2	Tinjauan Pustaka	16
BAB III	METODOLOGI PENELITIAN	21
3.1	Desain Penelitian.....	21
3.2	Definisi Operasional Variabel	21
3.2.1	Indeks LQ45	21
3.2.2	Real Effective Exchange Rate (REER).....	22
3.2.3	Consumer Price Index (CPI)	22
3.2.4	Suku Bunga (JIBOR 3 bulan)	23
3.2.5	M2	23
3.3	Populasi dan Sampel	23
3.4	Teknik Pengumpulan Data	24
3.5	Teknik Analisis Data	25
3.5.1	Uji Akar Unit (Unit Root)	26
3.5.2	Model Threshold Autoregressive (TAR).....	26
BAB IV	HASIL PENELITIAN DAN PEMBAHASAN	28
4.1	Statistik Diskriptif.....	28
4.2	Pembahasan.....	31
4.2.1	Uji Akar Unit (<i>Unit Root</i>)	31
4.2.2	Hasil Estimasi TAR.....	32
4.2.3	Uji <i>Robustness</i> Atau Sensitivitas Model	37
BAB V	KESIMPULAN.....	40
5.1	Simpulan	40
5.2	Keterbatasan Penelitian	41
5.3	Implikasi.....	41
	Daftar Pustaka	44
	Lampiran	48