

DAFTAR ISI

HALAMAN JUDUL	i
LEMBAR PERSETUJUAN	ii
LEMBAR PENGESAHAN	iii
LEMBAR PERNYATAAN KEASLIAN KARYA TULIS	iv
HALAMAN PERSEMBAHAN.....	v
KATA PENGANTAR.....	vi
DAFTAR ISI.....	viii
DAFTAR TABEL	x
DAFTAR GRAFIK.....	xi
ABSTRAK	xii
ABSTRACT	xiii
BAB I PENDAHULUAN.....	1
1.1 Latar Belakang Penelitian	1
1.2 Rumusan Masalah	6
1.3 Pertanyaan Penelitian	6
1.4 Tujuan Penelitian.....	7
1.5 Batasan Penelitian.....	7
1.6 Manfaat Penelitian	8
1.7 Sistematika Penulisan.....	8
BAB II LANDASAN TEORI DAN TINJAUAN PUSTAKA	10
2.1 Landasan Teori	10
2.1.1 Pasar Modal.....	10
2.1.2 Instrumen Pasar Modal	11
2.1.3 Integrasi Pasar Modal.....	14
2.1.4 Diversifikasi Internasional.....	15
2.1.5 Teori Portofolio	16
2.1.6 Risiko dan Return Investasi.....	18



2.2	Pengembangan Hipotesis	20
2.2.1	Penelitian Sebelumnya	20
2.2.2	Hipotesis Penelitian	21
BAB III METODE PENELITIAN		22
3.1	Desain Penelitian	23
3.3	Metode Pengumpulan Data	24
3.4	Populasi dan Sampel ()	25
3.5	Identifikasi Variabel	25
3.6	Definisi Operasional Variabel	27
3.7	Teknik Analisis	29
3.7.1	Uji Akar Unit (Augmented Dickey Fuller Test)	29
3.7.2	Penentuan Lag	31
3.7.3	Analisis Korelasi Pearson	32
3.7.4	Uji Kointegrasi	33
3.7.5	Uji Kausalitas Granger	34
BAB IV HASIL DAN PEMBAHASAN		36
4.1	Software Pengolah Data Penelitian	36
4.2	Analisis Deskriptif dan Grafik	36
4.3	Uji Akar Unit (Augmented Dickey Fuller Test)	38
4.4	Penentuan Lag Optimum	40
4.5	Analisis Korelasi Pearson	41
4.6	Uji Kointegrasi	43
4.7	Uji Kausalitas Granger	47
BAB V KESIMPULAN DAN SARAN		57
5.1	Kesimpulan	57
5.2	Keterbatasan Penelitian	60
5.3	Saran	61
DAFTAR PUSTAKA		62
LAMPIRAN		64