

## DAFTAR ISI

<b>HALAMAN JUDUL</b> .....	<b>i</b>
<b>HALAMAN PENGESAHAN</b> .....	<b>ii</b>
<b>PERNYATAAN KEASLIAN</b> .....	<b>iii</b>
<b>HALAMAN PERSEMBAHAN</b> .....	<b>iv</b>
<b>DAFTAR ISI</b> .....	<b>viii</b>
<b>DAFTAR TABEL</b> .....	<b>x</b>
<b>DAFTAR GAMBAR</b> .....	<b>xi</b>
<b>DAFTAR LAMPIRAN</b> .....	<b>xii</b>
<b>INTISARI</b> .....	<b>xiii</b>
<b>ABSTRACT</b> .....	<b>xiv</b>
<b>BAB I PENDAHULUAN</b> .....	<b>1</b>
1.1 Latar Belakang .....	1
1.2 Rumusan Masalah .....	7
1.3 Pertanyaan Penelitian .....	7
1.4 Tujuan Penelitian .....	8
1.5 Manfaat Penelitian .....	8
1.6 Sistematika Penelitian .....	9
<b>BAB II LANDASAN TEORI DAN PENGEMBANGAN HIPOTESIS</b> .....	<b>11</b>
2.1 Integrasi Pasar Saham .....	11
2.2 <i>Asset Pricing Theory</i> .....	18
2.3 Variabel Informasi Global .....	22
2.4 Variabel Informasi Lokal .....	26
2.5 <i>Seemingly Unrelated Regression</i> .....	27
2.6 Penelitian Terdahulu .....	29
2.7 Pengembangan Hipotesis .....	31
<b>BAB III METODE PENELITIAN</b> .....	<b>34</b>
3.1 Jenis Penelitian .....	34
3.2 Jenis dan Sumber Data .....	35
3.3 Definisi Operasional Variabel .....	36

3.4 Metode Pengujian Hipotesis .....	37
<b>BAB IV HASIL PENELITIAN DAN PEMBAHASAN.....</b>	<b>40</b>
4.1 Statistik Deskriptif .....	40
4.2 Pengujian Hipotesis Integrasi Pasar .....	44
4.3 Pembahasan .....	49
<b>BAB V PENUTUP .....</b>	<b>51</b>
5.1 Kesimpulan .....	51
5.2 Saran .....	52
<b>DAFTAR PUSTAKA .....</b>	<b>53</b>
<b>LAMPIRAN</b>	