

DAFTAR ISI

HALAMAN JUDUL	i
HALAMAN PENGESAHAN	ii
HALAMAN PERNYATAAN	iii
KATA PENGANTAR.....	iv
DAFTAR ISI.....	vi
DAFTAR TABEL	viii
DAFTAR LAMPIRAN	ix
INTISARI	xi
ABSTRACT.....	xii

I. PENDAHULUAN

1.1. Latar Belakang Penelitian	1
1.2. Perumusan Masalah	2
1.3. Tujuan Penelitian.....	3
1.4. Batasan Penelitian.....	3
1.5. Manfaat Penelitian	4
1.6. Sistematika Penulisan	4

II. LANDASAN TEORI

2.1. Bursa Efek Indonesia (BEI)	6
2.2. Indeks-indeks di BEI.....	8
2.3. Metode Perhitungan Indeks Pasar Modal	9
2.4. <i>Efficient Market Hypothesis</i>	11

2.5. Teori <i>Random Walk</i>	14
2.6. Uji Statistik Durbin-Watson	15
2.7. Uji Kausalitas Granger	16
2.8. Penelitian Terdahulu	17
2.9. Pengembangan Hipotesis	17

III. METODA PENELITIAN

3.1. Data dan Teknik Pengumpulan.....	22
3.2. Alat Bantu Pengolahan dan Analisa Data	23
3.3. Variabel Penelitian.....	23
3.4. Metoda Pengolahan Data	24
3.5. Statistika Deskriptif	25
3.6. Pengujian Unit Root.....	26
3.7. Pengujian Hubungan Linier Sewaktu	27
3.8. Pengujian Statistik Durbin-Watson dan Kausalitas Granger	29
3.8.1. Model pengujian <i>random walk</i>	29
3.8.2. Model Uji Kausalitas Granger	30

IV. HASIL PENELITIAN DAN DISKUSI

4.1. Statistika Deskriptif Data	32
4.2. Hasil Pengujian Stasioneritas	35
4.3. Hasil Analisis Random Walk	39
4.4. Hasil Analisis Hubungan Sewaktu (<i>contemporaneous relationship</i>).....	41

4.5. Hasil Analisis Korelasi Bivariat	41
4.6. Hasil Analisis Regresi Linier.....	42
4.7. Hasil Analisis Kausalitas Granger	43

V. KESIMPULAN DAN SARAN

5.1. Kesimpulan	48
5.2. Keterbatasan Penelitian dan Saran.....	49