

DAFTAR ISI

KATA PENGANTAR	i
DAFTAR ISI.....	ii
DAFTAR GAMBAR	iv
DAFTAR TABEL.....	v
DAFTAR LAMPIRAN.....	vi
ABSTRAK	vii
ABSTRACT.....	viii
BAB I.....	1
PENDAHULUAN	1
1.1. Latar Belakang	1
1.2. Rumusan Masalah	7
1.3. Pertanyaan Penelitian	7
1.4. Tujuan Penelitian.....	7
1.5. Manfaat Penelitian.....	8
BAB II.....	9
TINJAUAN PENELITIAN.....	9
2.1. Landasan Teori	9
2.1.1. Pasar Modal	9
2.1.2. Integrasi Pasar Modal.....	11
2.1.3. Diversifikasi dan Teori Portofolio Modern.....	13
2.2. Kajian Penelitian Terdahulu	15
2.3. Kerangka Penelitian	18
BAB III	20
METODA PENELITIAN	20
3.1. Desain Penelitian	20
3.2. Metode Pengumpulan Data	20
3.2.1. Jenis dan Sumber Data.....	20
3.2.2. Populasi dan Sampel Penelitian	20

3.3.	Instrumen Penelitian	22
3.4.	Metode Analisis Data	24
BAB IV		30
ANALISIS DAN PEMBAHASAN		30
4.1.	Deskriptif data	30
4.1.1.	Deskriptif Data Indeks Harga Saham Sebelum MEA.....	30
4.1.2.	Deskriptif Data Indeks Harga Saham Setelah pemberlakuan MEA	31
4.1.3.	Deskriptif Data <i>Return</i> Saham Sebelum MEA.....	32
4.1.4.	Deskriptif Data <i>Return</i> Saham Setelah pemberlakuan MEA.....	33
4.2.	Deteksi Stasioneritas: Uji Akar Unit	34
4.2.1.	Uji Akar Unit Sebelum MEA.....	34
4.2.1.	Uji Akar Unit Setelah pemberlakuan MEA	35
4.3.	Uji Kointegrasi Johansen.....	37
4.3.1.	Uji Kointegrasi Sebelum MEA	37
4.3.2.	Uji Kointegrasi Setelah pemberlakuan MEA.....	39
4.4.	Vector Error Correction Model (VECM)	40
4.4.1.	VECM Sebelum MEA	41
4.4.1.	VECM Setelah pemberlakuan MEA	42
4.5.	VEC Granger Causality	43
4.5.1.	VEC Granger Causality Sebelum MEA.....	43
4.5.2.	VEC Granger Causality Setelah pemberlakuan MEA	44
BAB V.....		47
KESIMPULAN DAN SARAN.....		47
5.1.	Kesimpulan.....	47
5.2.	Implikasi	48
5.3.	Keterbatasan	48
5.2.	Saran	49
DAFTAR PUSTAKA		50