

Daftar Isi

Halaman Judul.....	i
Halaman Pengesahan	ii
Halaman Pernyataan Bebas Plagiasi.....	iii
Kata Pengantar	iv
Daftar Isi.....	vi
Daftar Tabel.....	viii
Daftar Lampiran	ix
Intisari	x
<i>Abstract</i>	xi
BAB I. PENDAHULUAN.....	1
1.1 Latar Belakang	1
1.2 Rumusan Masalah	5
1.3 Pertanyaan Penelitian	5
1.4 Tujuan Penelitian	6
1.5 Motivasi Penelitian	6
1.6 Manfaat Penelitian	7
1.7 Kontribusi Penelitian	7
1.7.1 Kontribusi Praktis	7
1.7.2 Kontribusi Teoritis	7
1.7.3 Kontribusi Kebijakan.....	8
1.8 Ruang Lingkup dan Batasan Penelitian	8
1.9 Sistematika Penulisan	10
BAB II. LANDASAN TEORI DAN TINJAUAN PUSTAKA	11
2.1 Landasan Teori	11
2.1.1 Pasar Efisien	11
2.1.2 Pasar Modal.....	12
2.1.3 <i>Global Fear Index</i> (GFI)	12
2.1.4 <i>Volatility Index</i> (VIX).....	14
2.1.5 Saham	15
2.1.6 <i>Return</i> Saham	17
2.2 Tinjauan Pustaka dan Hipotesis	18
2.2.1 Tinjauan Pustaka	18
2.2.2 Hipotesis	21
BAB III. METODE PENELITIAN	24
3.1 Desain Penelitian.....	24

3.2 Definisi Operasional Variabel.....	24
3.2.1 Variabel Bebas (<i>Independent Variable</i>)	24
3.2.2 Variabel Terikat (<i>Dependent Variable</i>).....	27
3.3 Populasi dan Sampel	28
3.4 Instrumen Penelitian.....	30
3.5 Teknik Pengumpulan Data	34
3.6 Teknik Analisis Data	35
3.6.1 Statistik Deskriptif	35
3.6.2 Uji Asumsi Klasik.....	35
3.6.3 Uji Hipotesis 1	37
3.6.4 Uji Hipotesis 2	38
3.6.5 Uji Hipotesis 3	39
BAB IV. HASIL PENELITIAN DAN PEMBAHASAN.....	42
4.1 Deskripsi Data.....	42
4.2 Pengujian Asumsi Klasik	44
4.2.1 Uji Normalitas	44
4.2.2 Uji Multikolinearitas.....	46
4.2.3 Uji Heteroskedastisitas	47
4.3 Pengujian Hipotesis	51
4.3.1 Pengujian Hipotesis 1	51
4.3.2 Pengujian Hipotesis 2.....	53
4.3.3 Pengujian Hipotesis 3.....	55
4.4 Pembahasan	57
4.4.1 Hasil Uji Hipotesis 1	57
4.4.2 Hasil Uji Hipotesis 2	59
4.4.3 Hasil Uji Hipotesis 3	60
BAB V. SIMPULAN.....	61
5.1 Simpulan.....	61
5.2 Keterbatasan	62
5.3 Implikasi.....	62
Daftar Pustaka	64
Lampiran	67