



Daftar Isi

| | |
|---|------|
| Halaman Judul | i |
| HALAMAN PENGESAHAN DOSEN PENGUJI..... | ii |
| HALAMAN PENGESAHAN SKRIPSI..... | iii |
| PERNYATAAN KEASLIAN KARYA TULIS SKRIPSI | iv |
| Abstrak | v |
| <i>Abstract</i> | vi |
| Kata Pengantar | vii |
| Halaman Persembahan | ix |
| Daftar Isi | x |
| Daftar Tabel | xii |
| Daftar Grafik | xiii |
| BAB I Pendahuluan | 1 |
| 1.1 Latar Belakang | 1 |
| 1.2 Permasalahan Penelitian..... | 7 |
| 1.3 Tujuan Penelitian..... | 7 |
| 1.4 Manfaat Penelitian..... | 8 |
| BAB II Landasan Teori dan Pengembangan Hipotesis | 9 |
| 2.1 Variabel Makroekonomi dan Pasar Saham | 9 |
| 2.2 Teori pasar efisiensi | 9 |
| 2.3 Tinjauan Empiris | 10 |
| 2.4 Pengembangan Hipotesis | 12 |
| 2.4.1 Hubungan antara <i>industrial production index</i> dengan Indeks LQ45 | 12 |
| BAB II Metode Penelitian..... | 14 |
| 3.1 Data dan Sampel..... | 14 |
| 3.2 Definisi Variabel | 14 |
| 3.2.1 Variabel Dependen..... | 14 |



| | | |
|--------|--|----|
| 3.2.2 | Variabel Independen | 14 |
| 3.2.3 | Variabel Kontrol | 15 |
| 3.3 | Model Pengujian | 16 |
| 3.3.1 | Uji Asumsi Klasik..... | 16 |
| 3.3.2 | Uji <i>Error Correction Model</i> | 17 |
| 3.3.3 | Uji <i>Error Correction Term</i> (ECT) | 19 |
| BAB IV | Analisis dan Pembahasan | 20 |
| 4.1 | Analisis data | 20 |
| 4.1.1 | Uji Error Correction Model (ECM) | 21 |
| 4.2 | Interpretasi data | 24 |
| 4.2.1 | Konstanta | 24 |
| 4.2.2 | Pengaruh <i>industrial production index</i> terhadap indeks LQ45 | 25 |
| 4.2.3 | Pengaruh variabel kontrol terhadap indeks LQ45..... | 25 |
| 4.3 | Pembahasan analisis statistik | 27 |
| 4.3.1 | Jangka pendek | 27 |
| 4.3.2 | Jangka panjang | 29 |
| BAB V | Kesimpulan dan Saran | 32 |
| 5.1 | Kesimpulan..... | 32 |
| 5.2 | Saran..... | 32 |
| | Daftar Pustaka | 34 |
| | Lampiran | 36 |



Daftar Tabel

| | |
|---|----|
| Tabel 4.1 Statistik deskriptif | 20 |
| Tabel 4.2 Hasil Regresi Error Corection Model | 22 |
| Tabel 4.3 Hasil Regresi ECM | 24 |



UNIVERSITAS
GADJAH MADA

Analisis Pengaruh Industrial Production Index terhadap Indeks LQ45
WIDYO NURPATWIKANTO, Singgih Wijayana, S.E., M.Si., Ph.D
Universitas Gadjah Mada, 2015 | Diunduh dari <http://etd.repository.ugm.ac.id/>

Daftar Grafik

| | |
|--|---|
| Grafik 1.1 Data Pertumbuhan GDP Indonesia..... | 4 |
|--|---|