

DAFTAR ISI

HALAMAN JUDUL	i
SERTIFIKASI	ii
PENGESAHAN TESIS.....	iii
ABSTRACT	iv
ABSTRAK	v
KATA PENGANTAR.....	vi
DAFTAR ISI.....	viii
DAFTAR TABEL	xi
DAFTAR GAMBAR.....	xii
 BAB I PENDAHULUAN.....	 1
1.1. Latar Belakang Masalah	1
1.2. Rumusan Masalah.....	9
1.3. Tujuan Penelitian	11
1.4. Manfaat Penelitian	11
1.5. Sistematika Penulisan	12
 BAB II TINJAUAN PUSTAKA.....	 14
2.1. Landasan Teori.....	14
2.1.1. Investasi.....	14
2.1.2. Pasar Modal.....	15
2.1.3. <i>Return</i> Pasar	16
2.1.4. Instrumen Pasar Modal di Indonesia.....	17
2.1.5. Harga Saham	21
2.1.6. Analisis Harga Saham	21
2.1.7. Indeks Harga Saham Gabungan (IHSG).....	22
2.1.8. Harga Minyak Dunia	23
2.1.9. <i>Dow Jones Industrial Average</i> (DJIA).....	28
2.1.10. Hubungan Harga Minyak Dunia dan <i>Return</i> Pasar Saham	30

2.2.	Penelitian Terdahulu	32
2.3.	Pengaruh antar Variabel dan Rumusan Hipotesis	39
2.3.1.	Pengaruh Harga Minyak Dunia terhadap IHSG	39
2.3.2.	Pengaruh Harga Minyak Dunia terhadap Indeks Dow Jones..	40
2.3.3.	Pengaruh Indeks Dow Jones terhadap IHSG.....	41
2.3.4.	Hubungan antara IHSG dan Pandemi Covid-19	42
2.4.	Hipotesis Penelitian	43
2.5.	Kerangka Pemikiran.....	44
BAB III METODOLOGI PENELITIAN		45
3.1.	Variabel Penelitian dan Definisi Operasional Variabel.....	45
3.1.1.	Variabel Dependen.....	45
3.1.2.	Variabel Independen.....	46
3.1.3.	Variabel Intervening.....	47
3.1.4.	Variabel Kontrol	47
3.1.5.	<i>Average Volatility Index (RV)</i>	48
3.1.6.	<i>Return IHSG</i> saat t-1.....	48
3.2.	Pouulasi dan Sampel	51
3.2.1.	Populasi Penelitian	51
3.2.2.	Sampel Penelitian	51
3.3.	Jenis dan Sumber Data	52
3.4.	Metode Pengumpulan Data.....	52
3.5.	Metode Analisis	52
3.5.1.	Uji Statistik Deskriptif.....	52
3.5.2.	<i>Autoregressive Orde 1</i>	53
3.5.3.	Uji Normalitas	53
3.5.4.	Uji Stasioneritas	53
3.5.5.	Uji Regresi.....	54
3.5.6.	Uji Signifikansi Koefisien	57
3.5.7.	Uji Beda.....	57

BAB IV HASIL PENELITIAN.....	59
4.1. Deskripsi Objek Penelitian.....	59
4.1.1. Gambaran Umum Objek Penelitian.....	59
4.1.2. Deskripsi Data Penelitian	59
4.1.3. Autoregressive Orde 1	61
4.1.4. Uji Normalitas	62
4.1.5. Uji Stasioneritas	62
4.2. Hasil Analisis Regresi.....	63
4.2.1. Analisis Regresi OLS dan FGLS	63
4.2.2. Uji Regresi dengan Variabel Intervening	67
4.2.3. Uji Beda.....	69
4.3. Pembahasan	69
BAB V PENUTUP	76
5.1. Kesimpulan Masalah Penelitian	76
5.2. Implikasi Teoritis	77
5.3. Implikasi Manajerial.....	80
5.4. Keterbatasan Penelitian.....	81
5.5. Saran untuk Penelitian Mendatang.....	82
DAFTAR PUSTAKA	83
LAMPIRAN.....	90