

DAFTAR ISI

LEMBAR PENGESAHAN	i
PERNYATAAN SIMILARITY CHECK	ii
LEMBAR PERNYATAAN	iii
ABSTRACT	iv
ABSTRAK	v
KATA PENGANTAR	vi
DAFTAR ISI	viii
DAFTAR GAMBAR	xi
DAFTAR TABEL	xii
DAFTAR LAMPIRAN	xiii
BAB 1 PENDAHULUAN	
1.1 Latar Belakang	1
1.2 Identifikasi Masalah	5
1.3 Pembatasan Masalah	5
1.4 Rumusan Masalah	5
1.5 Tujuan Penelitian	6
BAB II TINJAUAN PUSTAKA	
2.1 Kajian Teori	7
2.1.1 Saham Dual Listing	7
2.1.2 Harga Saham	9

2.1.3 Transfer Informasi Harga Saham	9
2.1.4 American Deposit Receipt (ADR)	11
2.1.5 Hipotesis Pasar	12
2.1.6 Interdependensi Pasar Saham	17
2.1.7 Efficient Market Hypothesis	18
2.2 Penelitian Terdahulu	20
2.3 Kerangka Pemikiran	28
2.4 Hipotesis	29

BAB III METODOLOGI PENELITIAN

3.1 Jenis Penelitian	30
3.2 Defenisi Operasional	30
3.3 Populasi dan Sampel	30
3.4 Metode Pengumpulan Data	32
3.5 Metode Analisis Data	32
3.5.1 Analisis Deskriptif	33
3.5.2 Uji Stationer	33
3.5.3 Uji Kausalitas Granger	36
3.5.4 Uji Kointegrasi	39
3.5.5 Pemodelan VAR/VECM	40

BAB IV HASIL PENELITIAN DAN PEMBAHASAN

4.1 Deskripsi Perusahaan (Industri)	45
4.1.1 Sejarah Perusahaan	45
4.1.2 Lingkup dan Bidang Usaha	48
4.1.3 Kinerja Telkom	49

4.2 Hasil Penelitian	51
4.2.1 Uji Deskripsi Statik	52
4.2.2 Uji Stationery	56
4.2.3 Uji Panjang Lag Optimal	58
4.2.4 Uji Stabilitas Model VAR	60
4.2.5 Uji Kointegrasi	61
4.2.6 Uji Kausalitas Granger	64
4.2.7 Uji VAR / VECM	65
BAB V KESIMPULAN	
5.1 Kesimpulan	70
5.2 Saran	70
DAFTAR PUSTAKA	71
LAMPIRAN	76
DAFTAR RIWAYAT HIDUP	106

