

DAFTAR ISI

HALAMAN JUDUL	i
HALAMAN PENGESAHAN	ii
HALAMAN PERNYATAAN	iii
KATA PENGANTAR	iv
ABSTRAK	v
<i>ABSTRACT</i>	vi
DAFTAR ISI	vii
DAFTAR TABEL	x
DAFTAR GAMBAR	xi
BAB I PENDAHULUAN	1
1.1. Gambaran Umum Objek Penelitian	1
1.2. Latar Belakang Penelitian	2
1.3. Perumusan Masalah	7
1.4. Tujuan Penelitian	8
1.5. Manfaat Penelitian	8
1.6. Sistematika Penulisan Tugas Akhir	10
BAB II TINJAUAN PUSTAKA	12
2.1. Teori – Teori dan Penelitian Terdahulu	12
2.1.1. Landasan Teori	12
2.1.1.1. Teori Ekspektasi (<i>Expectations Theory</i>)	12
2.1.1.2. Mekanisme Transmisi Kebijakan Moneter	13
2.1.1.3. Teori Sinyal (<i>Signaling Theory</i>)	15
2.1.1.4. <i>Efficient Market Hypothesis</i> (EMH)	16

2.1.2.	Komunikasi Bank Sentral	17
2.1.3.	Volatilitas Pasar Saham	22
2.1.4.	Penelitian Terdahulu	26
2.2.	Kerangka Pemikiran	33
2.3.	Hipotesis Penelitian	35
BAB III METODE PENELITIAN		38
3.1.	Jenis Penelitian	38
3.2.	Operasionalisasi Variabel	39
3.3.	Tahapan Penelitian.....	41
3.4.	Pengumpulan Data dan Sumber Data	44
3.5.	Teknik Analisis Data	45
3.5.1.	Analisis Komunikasi Bank Indonesia	45
3.5.2.	Analisis Regresi.....	47
BAB IV HASIL PENELITIAN DAN PEMBAHASAN.....		54
4.1.	Deskripsi Data Penelitian	54
4.2.	Hasil Analisis Komunikasi Bank Indonesia	56
4.2.1.	Analisis Sentimen Komunikasi.....	56
4.2.2.	Analisis Kejelasan (<i>Clarity</i>) Komunikasi	74
4.2.3.	Pola Temporal Komunikasi, Makroekonomi, Kondisi Pasar, dan Peristiwa Ekonomi	77
4.3.	Hasil Analisis Regresi.....	79
4.4.	Pembahasan Hasil Penelitian	87
4.4.1.	Pengaruh Suku Bunga terhadap Volatilitas IHSG.....	87
4.4.2.	Pengaruh Inflasi terhadap Volatilitas IHSG.....	89

4.4.3. Pengaruh Dimensi Komunikasi Bank Indonesia terhadap Volatilitas IHSG	91
4.4.4. Moderasi Komunikasi pada Pengaruh Suku Bunga terhadap Volatilitas	93
4.4.5. Moderasi Komunikasi pada Pengaruh Inflasi terhadap Volatilitas	96
BAB V KESIMPULAN DAN SARAN	99
5.1. Kesimpulan	99
5.2. Saran.....	100
DAFTAR PUSTAKA	102