

DAFTAR ISI

ABSTRAK	iii
LEMBAR PENGESAHAN	v
PERNYATAAN ORISINALITAS	vi
KATA PENGANTAR	vii
DAFTAR ISI	x
DAFTAR LAMPIRAN	xii
DAFTAR TABEL	xiii
DAFTAR GAMBAR	xiv
BAB I PENDAHULUAN	
A. Latar Belakang Masalah	1
B. Perumusan Masalah	10
C. Tujuan Penelitian	11
D. Kegunaan Penelitian	12
BAB II KAJIAN TEORITIK	
A. <i>Signalling Theory</i>	14
B. Obligasi	15
C. Hasil Penelitian yang Relevan	35
D. Kerangka Teoritik	45
E. Perumusan Hipotesis Penelitian	47
BAB III METODOLOGI PENELITIAN	
A. Tujuan Penelitian	52
B. Objek dan Ruang Lingkup Penelitian	52
C. Metode Penelitian	53

D. Populasi dan Sampel.....	53
E. Jenis dan Sumber Data	54
F. Operasional Variabel Penelitian	54
G. Teknik Analisis Data.....	57

BAB IV HASIL PENELITIAN DAN PEMBAHASAN

A. Deskripsi Data.....	66
B. Pengujian Hipotesis.....	70
C. Pembahasan Hasil.....	84

BAB V KESIMPULAN, IMPLIKASI, DAN SARAN

A. Kesimpulan	90
B. Implikasi.....	91
C. Saran.....	92

DAFTAR PUSTAKA

LAMPIRAN

RIWAYAT HIDUP

DAFTAR LAMPIRAN

Lampiran 1. Daftar Sampel Obligasi Pemerintah Seri Variabel Rate	97
Lampiran 2. Daftar Harga Obligasi Pemerintah Seri Variabel Rate	97
Lampiran 3. Daftar Tingkat Inflasi	97
Lampiran 4. Daftar Kupon Obligasi	98
Lampiran 5. Daftar Maturitas Obligasi Setelah Ditransformasikan ke dalam Bentuk Logaritma.....	98
Lampiran 6. Daftar Suku Bunga SBI	98
Lampiran 7. <i>Workfile</i> dalam Bentuk Data Panel.....	99
Lampiran 8. Tabel Durbin Watson.....	101
Lampiran 9. Tabel Uji t.....	102
Lampiran 10. Tabel Uji F.....	103
Lampiran 11. Hasil Perhitungan Eviews 9.....	104

DAFTAR TABEL

Tabel II.1 Kategori Rating Pada PT PEFINDO	24
Tabel II.2 Penelitian Terdahulu.....	35
Tabel IV.1 Hasil Pengambilan Sampel.....	66
Tabel IV.2 Jumlah Sampel Penelitian.....	67
Tabel IV.3 Hasil Statistik Deskriptif.....	67
Tabel IV.4 Hasil Uji Chow.....	71
Tabel IV.5 Hasil Uji <i>Lagrange Multiplier Test</i>	72
Tabel IV.6 Hasil Uji Multikorelasi.....	74
Tabel IV.7 Hasil Uji Autokorelasi.....	75
Tabel IV.8 Hasil Uji Heterokedastisitas.....	76
Tabel IV.9 Hasil Uji Regresi Linier Berganda	77
Tabel IV.10 Hasil Uji Hipotesis	80
Tabel IV.11 Hasil Uji Kelayakan Model (Uji F)	82
Tabel IV.12 Hasil Uji Koefisien Determinasi (R^2)	83

DAFTAR GAMBAR

Gambar I.1 Instrumen Utang Pemerintah.....	3
Gambar II.1 Kerangka Konseptual.....	47
Gambar IV.1 Hasil Uji Normalitas.....	73
Gambar IV.2 Kesimpulan Model Konseptual.....	89