

DAFTAR ISI

	Halaman
Halaman Judul	i
Halaman Persetujuan	ii
Halaman Pernyataan Orisinalitas Skripsi	iii
Kata Pengantar	iv
Abstrak	viii
Abstract	ix
Daftar Isi	x
Daftar Tabel	xiv
Daftar Gambar	xv
Daftar Lampiran	xvi
 BAB 1 : PENDAHULUAN	
1.1. Latar Belakang Permasalahan	1
1.2. Rumusan Masalah	10
1.3. Tujuan Penelitian	10
1.4. Manfaat Penelitian	11
1.5. Sistematika Penelitian	12
 BAB 2 : TINJAUAN PUSTAKA	
2.1. Landasan Teori	14
2.1.1. Definisi Pasar Modal	14
2.1.2. Bentuk-Bentuk Pasar Modal	14
2.1.3. Instrumen Pasar Modal	15

2.1.4. Pasar Modal Indonesia	17
2.1.5. Contagion Effect Theory	20
2.1.6. Teori Integrasi Pasar Modal Dunia	21
2.1.7. Indeks Harga Saham Gabungan	22
2.1.8. Nilai Tukar Mata Uang	24
2.1.9. Indeks Dow Jones	26
2.1.10. Indeks Nikkei 225	27
2.1.11. Harga Emas Dunia	29
2.1.12. Harga Minyak Dunia	30
2.2. Pengaruh Faktor-Faktor Internal Dan Eksternal terhadap IHSG	32
2.2.1. Pengaruh Nilai Tukar Rupiah terhadap IHSG	32
2.2.2. Pengaruh Indeks Dow Jones terhadap IHSG	33
2.2.3. Pengaruh Indeks Nikkei 225 terhadap IHSG	33
2.2.4. Pengaruh Harga Emas Dunia terhadap IHSG	34
2.2.5. Pengaruh Harga Minyak Dunia terhadap IHSG	35
2.3. Penelitian Sebelumnya	36
2.4. Hipotesis dan Model Analisis	39
2.4.1. Hipotesis Penelitian	40
2.4.2. Model Analisis	40
2.5. Kerangka Berfikir	41

BAB 3 : METODE PENELITIAN

3.1. Pendekatan Penelitian	43
3.2. Identifikasi Variabel	43
3.3. Definisi Operasional Variabel	44

3.4. Jenis dan Sumber Data	47
3.5. Prosedur Pengumpulan Data	48
3.5.1. Prosedur Penentuan Data	48
3.6. Teknik Analisis	49
3.6.1. Persamaan Garis Regresi	49
3.6.2. Menghitung Koefisien Determinasi (R^2)	50
3.6.3. Melakukan Uji t	50
3.6.4. Melakukan Uji f	52
3.6.5. Melakukan Uji Asumsi Klasik	53

BAB 4 : HASIL DAN PEMBAHASAN

4.1. Gambaran Umum Subyek dan Obyek Penelitian	56
4.1.1. Bursa Efek Indonesia (BEI)	56
4.1.2. Perkembangan Indeks Harga Saham Gabungan (IHSG)	57
4.1.3. Perkembangan Indeks Dow Jones	62
4.1.4. Perkembangan Indeks Nikkei 225	64
4.1.5. Perkembangan Nilai Tukar Rupiah	65
4.1.6. Perkembangan Harga Emas Dunia	69
4.1.7. Perkembangan Harga Minyak Dunia	71
4.2. Deskripsi Hasil Penelitian	72
4.3. Analisis Model dan Uji Hipotesis	75
4.3.1. Uji Asumsi Klasik	76
4.3.1.1. Uji Gejala Multikolinearitas	76
4.3.1.2. Uji Gejala Autokorelasi	78
4.3.1.3. Uji Gejala Heteroskedastisitas	78

4.3.1.4. Uji Normalitas	80
4.3.2. Uji Hipotesis	81
4.3.2.1. Koefisien Determinas	81
4.3.2.2. Uji F	82
4.3.2.3. Uji t	83
4.4. Pembahasan Hasil Penelitian	87
4.4.1. Pengaruh Perubahan Nilai Tukar Rupiah terhadap IHSG	87
4.4.2. Pengaruh Perubahan Harga Emas Dunia terhadap IHSG	87
4.4.3. Pengaruh Perubahan Harga Minyak Dunia terhadap IHSG	88
4.4.4. Pengaruh Perubahan Indeks Nikkei 225 terhadap IHSG	89
4.4.5. Pengaruh Perubahan Indeks Dow Jones terhadap IHSG	90
 BAB V : KESIMPULAN DAN SARAN	
5.1. Simpulan	91
5.2. Saran	92
 DAFTAR PUSTAKA	
 LAMPIRAN	

DAFTAR TABEL

	Halaman
Tabel 4.1 Deskripsi Variabel Dependen dan Independen Periode Mei 2013-Mei 2014	73
Tabel 4.2 Hasil Uji Multikolinearitas	77
Tabel 4.3 Hasil Uji Autokorelasi	78
Tabel 4.4 Koefisien Determinasi	81
Tabel 4.5 Uji F	82
Tabel 4.6 Uji Statistik Parametrik Secara Parsial	83



DAFTAR GAMBAR

	Halaman
Gambar 1.1 Grafik IHSG selama bulan Mei 2013-Mei 2014	4
Gambar 2.1 Kerangka Berfikir	42
Gambar 4.1 Grafik Perkembangan Indeks Harga Saham Gabungan (IHSG) Periode Mei 2013-Mei 2014	58
Gambar 4.2 Grafik Perkembangan Indeks Dow Jones Periode Mei 2013-Mei 2014	62
Gambar 4.3 Grafik Perkembangan Indeks Nikkei 225 Periode Mei 2013-Mei 2014	64
Gambar 4.4 Grafik Perkembangan Nilai Tukar Rupiah Periode Mei 2013-Mei 2014	66
Gambar 4.5 Grafik Perkembangan Harga Emas Dunia Periode Mei 2013-Mei 2014	69
Gambar 4.6 Grafik Perkembangan Harga Minyak Dunia Periode Mei 2013-Mei 2014	71
Gambar 4.7 Hasil Uji Scatterplot	79
Gambar 4.8 Hasil Uji Normal Probability Plot Tiap Sektor	80

DAFTAR LAMPIRAN

- Lampiran 1** : Data Historis Nilai IHSG
- Lampiran 2** : Nilai Tukar Mata Uang Rupiah terhadap Dollar AS
- Lampiran 3** : Data Historis Indeks Dow Jones
- Lampiran 4** : Data Historis Indeks Nikkei 225
- Lampiran 5** : Data Historis Harga Emas Dunia
- Lampiran 6** : Data Historis Harga Minyak Mentah Dunia
- Lampiran 7** : Perbandingan Data-Data Harian Variabel Penelitian
- Lampiran 8** : Perbandingan Perubahan Data Harian Variabel Penelitian
- Lampiran 9** : Data Bulanan Variabel Penelitian
- Lampiran 10** : Tabel Coefficients^a Hasil Perhitungan SPSS
- Lampiran 11** : Tabel Model Summary^b Hasil Perhitungan SPSS
- Lampiran 12** : Tabel ANOVA^a Hasil Perhitungan SPSS