

DAFTAR ISI

HALAMAN JUDUL.....	i
SURAT PERNYATAAN KEASLIAN TESIS.....	ii
HALAMAN PENGESAHAN.....	iii
ABSTRACT.....	iv
ABSTRAKSI.....	v
KATA PENGANTAR.....	vi
DAFTAR TABEL.....	xii
DAFTAR GAMBAR.....	xiii
DAFTAR GRAFIK.....	xiv
DAFTAR RUMUS.....	xv
BAB I PENDAHULUAN.....	1
1.1 Latar Belakang Masalah.....	1
1.2 Rumusan Masalah.....	17
1.3 Tujuan Penelitian.....	21
1.4 Manfaat Penelitian.....	22
1.5 Sistematika Penulisan.....	22
BAB II Telaah Pustaka.....	24
2.1 Telaah Pustaka.....	24
2.1.1 Teori Makro Ekonomi.....	24
2.1.2 Integrasi Pasar Modal Dunia.....	25
2.1.3 Pasar Modal Indonesia.....	28
2.1.4 Indeks Harga Saham Gabungan.....	31
2.1.5 Tingkat Suku Bunga SBI (BI rate).....	33
2.1.6 Harga Minyak Dunia.....	37
2.1.7 Harga Emas Dunia.....	39
2.1.8 Kurs Mata Uang.....	41
2.1.9 Indeks Nikkei 225.....	43
2.1.10 Indeks Dow Jones.....	45

2.2	Penelitian Terdahulu.....	48
2.3	Kerangka Pemikiran Teori.....	57
2.4	Hipotesis	62
BAB III	Metode Penelitian.....	63
3.1	Variabel Penelitian dan Definisi Operasional	63
3.1.1	Variabel Dependen	63
3.1.2	Variabel Independen	63
3.2	Populasi dan Sampel.....	67
3.3	Jenis dan Sumber Data	67
3.4	Metode Pengumpulan Data	68
3.5	Metode Analisis.....	68
3.5.1	Persamaan Garis Regresi.....	68
3.5.2	Uji Goodness of Fit	69
3.5.3	Uji Asumsi Klasik	72
BAB IV	Hasil dan Pembahasan.....	76
4.1	Deskripsi Obyek Penelitian	76
4.1.1	Deskripsi Variabel Dependen.....	78
4.1.2	Deskripsi Variabel Independen	81
4.1.2.1	Tingkat Suku Bunga SBI.....	81
4.1.2.2	Harga Minyak Dunia	83
4.1.2.3	Harga Emas Dunia.....	86
4.1.2.4	Kurs Rupiah.....	88
4.1.2.5	Indeks Nikkei 225.....	90
4.1.2.6	Indeks Dow Jones	92
4.2	Analisis Data dan Pembahasan.....	93
4.2.1	Uji Asumsi Klasik	93
4.2.2.1	Uji Normalitas	94
4.2.2.2	Uji Autokorelasi	96
4.2.2.3	Uji Heteroskedastisitas	97
4.2.2.4	Uji Multikolinearitas.....	99

4.3 Uji Hipotesis	100
4.3.1 Koefisien Determinasi	100
4.3.2 Uji F	102
4.3.3 Uji t	103
4.4 Pembahasan Hasil Hipotesis	106
4.4.1 Hipotesis 1	106
4.4.2 Hipotesis 2	107
4.4.3 Hipotesis 3	108
4.4.4 Hipotesis 4	109
4.4.5 Hipotesis 5	110
4.4.6 Hipotesis 6	110
BAB V Simpulan dan Implikasi Kebijakan	112
5.1 Simpulan	112
5.2 Implikasi Teoritis	112
5.3 Implikasi Manajerial	115
5.4 Keterbatasan Penelitian	116
5.5 Agenda Penelitian Mendatang	116
DAFTAR PUSTAKA	118
DAFTAR LAMPIRAN	

FEB UNDIP