

DAFTAR ISI

DAFTAR ISI	i
DAFTAR TABEL	iv
DAFTAR GAMBAR	v

BAB I PENDAHULUAN

1.1. Latar Belakang	1
1.2. Rumusan Masalah	6
1.3. Tujuan Penelitian	7
1.4. Manfaat Penelitian	8
1.5. Sistematika Penulisan	8

BAB II LANDASAN TEORI

2.1. Pasar Modal	10
2.1.1. Definisi Pasar Modal	10
2.1.2. Jenis-Jenis Pasar Modal	11
2.1.3. Instrumen Pasar Modal	13
2.1.4. Manfaat Keberadaan Pasar Modal	18
2.2. Return	19
2.3. Investasi	22
2.3.1. Definisi Investasi	22
2.3.2. Tujuan Investasi	23
2.4. Indeks Harga Saham	23
2.4.1. Metode Penghitungan Indeks Harga Saham	24
2.4.2. Permasalahan Dalam Perhitungan Indeks	27
2.5. Indeks Harga Saham Gabungan	29
2.5.1. Indeks Dow Jones	30
2.5.2. Indeks Nikkei 225	30

2.5.3. Indeks FTSE 100	31
2.5.4. Indeks KOSPI 200	31
2.5.5. Indeks Hang Seng	32
2.5.6. Indeks Straits Times	33
2.6. Penelitian Terdahulu	34
2.7. Pengembangan Hipotesis	37

BAB III METODE PENELITIAN

3.1. Jenis Penelitian	40
3.2. Populasi dan Sampel	40
3.3. Metode Pengambilan Sampel	40
3.4. Jenis dan Sumber Data	41
3.5. Identifikasi Variabel	41
3.5.1. Identifikasi Variabel Penelitian	41
3.5.2. Operasional Variabel	42
3.6. Analisis Data	43
3.6.1. Analisis Deskriptif	43
3.6.2. Uji Asumsi Klasik	43
3.6.3. Uji Regresi Berganda	46
3.6.4. Koefisien Korelasi	47

BAB IV ANALISIS DAN PEMBAHASAN

4.1. Perhitungan Sampel dan Deskripsi Variabel	48
4.1.1. Perhitungan Sampel	48
4.1.2. Gambaran Umum Bursa Saham	49
4.2. Analisis Deskriptif	52
4.3. Uji Asumsi Klasik	55
4.4. Analisis Regresi Berganda	60
4.5. Koefisien Determinasi	62
4.6. Pengujian Hipotesis	63

4.7. Uji F	64
4.8. Uji T	65
4.9. Koefisien Korelasi	68
4.10. Pembahasan Hasil Penelitian	70

BAB V PENUTUP

5.1. Kesimpulan	76
5.2. Keterbatasan Penelitian	78
5.3. Saran	78
5.4. Implikasi Penelitian	79

DAFTAR PUSTAKA

LAMPIRAN

DAFTAR GAMBAR

Gambar 2.1 Kerangka Pemikiran	38
Gambar 4.1 Grafik Pergerakan Indeks Saham Global	54
Gambar 4.2 Hasil Uji Heterokedastisitas Regresi	58

DAFTAR TABEL

Tabel 2.1 Ringkasan Penelitian Terdahulu	33
Tabel 3.1 Operasional Variabel	41
Tabel 4.1 Analisis Deskriptif	51
Tabel 4.2 Hasil Uji Normalitas Kolmogorov-Smirnov Regresi	55
Tabel 4.3 Hasil Uji Multikolinearitas Regresi	56
Tabel 4.4 Hasil Uji Autokorelasi Regresi	57
Tabel 4.5 Hasil Regresi Berganda	59
Tabel 4.6 Koefisien Deteminasi (R^2)	61
Tabel 4.7 Hasil Uji F.....	63
Tabel 4.8 Hasil Uji T	64
Tabel 4.9 Ringkasan Hasil Uji Hipotesis Secara Parsial	64
Tabel 4.10 Korelasi Pearson	67
Tabel 4.11 Klasifikasi Interval Nilai Koefisien Korelasi Pearson	68