

DAFTAR ISI

	Halaman
HALAMAN JUDUL	i
HALAMAN PERSETUJUAN DOSEN PEMBIMBING	ii
HALAMAN PENGESAHAN	iii
PERNYATAAN KEASLIAN	iv
HALAMAN MOTTO	v
HALAMAN PERSEMBAHAN	vi
KATA PENGANTAR	ix
DAFTAR ISI	xi
DAFTAR TABEL	xiv
DAFTAR GRAFIK	xv
DAFTAR GAMBAR	xvi
INTISARI	xvii
ABSTRAC	xviii
BAB I. PENDAHULUAN	1
1.1 Latar Belakang	1
1.2 Rumusan Masalah	7
1.3 Tujuan Penelitian	8
1.4 Manfaat Penelitian	8
1.5 Keaslian Penelitian	9
BAB II. KAJIAN PUSTAKA	12
2.1 Landasan teori	12
2.1.1 Pasar Modal Indonesia	12
2.1.2 Pelaku Pasar Modal	13
2.1.3 Investasi	13
2.1.4 <i>Self Regulatory Organization</i>	14
2.1.5 BEI dan IHSG	15
2.1.6 Efek Penularan (<i>Contagion Effect/ Domino Effect</i>)	16

2.1.7 Efficient Market Hypothesis (EMH)	18
2.1.7.1 Hipotesis Efisiensi Pasar bentuk Lemah	19
2.1.7.2 Hipotesis Efisiensi Pasar bentuk setengah kuat	19
2.1.7.3 Hipotesis Efisiensi Pasar bentuk kuat	19
2.1.8 Pengaruh Inflasi terhadap IHSG	20
2.1.9 Pengaruh PDB terhadap IHSG	21
2.1.10 Pengaruh Indeks Bursa Luar Negeri terhadap IHSG	22
2.1.10.1 Indeks New York Stock Exchange (NYSE)	23
2.1.10.2 Indeks Nikkei 225	23
2.2 Penelitian Terdahulu	24
2.3 Kerangka Pemikiran Konseptual	26
2.4 Hipotesis Penelitian	28
BAB III. METODE PENELITIAN	29
3.1 Jenis Penelitian	29
3.2 Jenis Data dan Sumber Data	29
3.3 Metode Analisis Data	29
3.4 Pengujian Statistik Analisis regresi	31
3.4.1 Uji t	32
3.4.2 Pengujian Koefisien Regresi Secara Serentak (Uji F)	32
3.4.3 Koefisien Determinasi (R^2)	33
3.5 Uji Asumsi Klasik	33
3.5.1 Uji Auto Korelasi	33
3.5.2 Uji Heterokedastisitas	34
3.5.3 Uji Multikolineritas	35
3.5.4 Uji Normalitas	36
3.6 Definisi Operasional Variabel Penelitian	36
BAB IV. ANALISIS DAN PEMBAHASAN	39
4.1 Uji Asumsi Klasik	39
4.1.1 Uji Autokorelasi	39
4.1.2 Uji Heterokedastisitas	40
4.1.3 Uji Multikolineritas	40

4.1.4 Uji Normalitas	41
4.2 Analisis Hasil Regresi	42
4.3 Pengujian t- Statistik	43
4.4 Pengujian Terhadap Koefisien Regresi (Uji F)	46
4.5 Interpretasi Terhadap Koefisien Determinan (R^2)	47
4.6 Pembahasan	47
BAB. V KESIMPULAN DAN SARAN	50
5.1 Kesimpulan	50
5.2 Saran	50
DAFTAR PUSTAKA	52
Lampiran 1: Data Penelitian	54
Lampiran 2: Data Penelitian (Dalam Bentuk Logaritma)	55
Lampiran 3: Hasil Regresi <i>Ordinary Least Square</i>	56
Lampiran 4: Uji Autokorelasi	57
Lampiran 5: Uji Heterokedastis	58
Lampiran 6: Uji Multikolinieritas	59
Lampiran 7: Uji Normalitas	60

DAFTAR TABEL

	Halaman
Tabel 1.1 Keaslian Penelitian	9
Tabel 4.1 Hasil Uji Normalitas	39
Tabel 4.2 Hasil Uji Autokorelasi	40
Tabel 4.3 Hasil Uji Heterokedastisitas	41
Tabel 4.4 Hasil Uji Multikolinieritas	41
Tabel 4.5 Hasil Analisis Regresi	42

DAFTAR GRAFIK

	Halaman
Grafik 1.1 Pergerakan IHSG Peiode 2011-2015	2
Grafik 1.2 Inflasi di Indonesia Periode 2011-2015	4
Grafik 1.3 Pertumbuhan PDB Periode 2011-2015	5
Grafik 1.4 Perubahan Indeks Luar Negeri Periode 2011-2015.....	6
Grafik 2.1 <i>Demand Pull Inflation</i>	20
Grafik 2.2 <i>Cost Push Inflation</i>	21

DAFTAR GAMBAR

	Halaman
Gambar 2.1 Kerangka Pemikiran Konseptual	26