

DAFTAR ISI

HALAMAN JUDUL.....	i
HALAMAN PERNYATAAN KEASLIAN	iv
HALAMAN MOTTO	vi
HALAMAN PERSEMBAHAN	vii
KATA PENGANTAR	viii
DAFTAR ISI.....	x
DAFTAR TABEL.....	xiii
DAFTAR GAMBAR	xiv
INTISARI.....	xv
BAB I	1
1.1 Latar Belakang Masalah.....	1
1.2 Rumusan Masalah	6
1.3 Tujuan Penelitian.....	6
1.4 Manfaat Penelitian.....	6
1.5 Keaslian Penelitian	7
BAB II.....	10
2.1 Landasan Teori	10
2.1.1 Teori Portofolio Modern.....	10
2.1.2 Indeks Harga Saham Gabungan.....	11
2.1.3 Emas.....	11
2.1.4 Kurs.....	11
2.1.5 Indeks Dow Jones	12
2.1.6 Indeks Nikkei	12
2.2 Hasil Penelitian Terdahulu	13
2.3 Kerangka Pemikiran Konseptual.....	15
2.4 Hipotesis Penelitian.....	18

BAB III	19
3.1 Jenis Penelitian.....	19
3.2 Data dan Sumber Data.....	19
3.3 Alat Analisis.....	20
3.3.1 Uji MWD (Mackinnon, White, dan Davidson)	20
3.3.2 Error Correction Model (ECM)	21
3.3.3 Uji Stasioneritas	22
3.4 Uji Kointegrasi	23
3.5 Uji Statistik.....	24
3.6 Uji Asumsi Klasik	25
3.7 Definisi Operasional Variabel	27
BAB IV	28
4.1 Deskripsi Penelitian.....	28
4.1.1 Indeks Harga Saham Gabungan.....	28
4.1.2 Harga Emas.....	29
4.1.3 Kurs.....	30
4.1.4 Indeks Dow Jones	31
4.1.5 Indeks Nikkei	31
4.2 Hasil dan Analisis.....	31
4.2.1 Uji MWD (Mackinnon, White, and Davidson)	32
4.2.2 Uji Stasioner Data (Uji Akar Unit).....	34
4.2.3 Hasil Uji Kointegrasi	35
4.2.4 Hasil Error Correction Model.....	35
4.2.5 Hasil Uji Asumsi Klasik Jangka Pendek	37
4.2.6 Hasil Uji Statistik Jangka Pendek.....	39
4.2.7 Hasil Uji Asumsi Klasik Jangka Panjang	40
4.2.8 Hasil Uji Statistik Jangka Panjang.....	42
4.3 Pembahasan.....	43
4.3.1 Analisis Pengaruh Harga Emas Terhadap IHSG	44
4.3.2 Analisis Pengaruh Kurs Rupiah terhadap IHSG.....	45
4.3.3 Analisis Pengaruh Indeks Dow Jones Terhadap IHSG	45

4.3.4 Analisis Pengaruh Indeks Nikkei Terhadap IHSG	46
BAB V	47
5.1 Kesimpulan.....	47
5.2 Saran.....	47
DAFTAR PUSTAKA	48
LAMPIRAN.....	50