

DAFTAR ISI

HALAMAN JUDUL	i
HALAMAN PERSETUJUAN	ii
HALAMAN PENGESAHAN	iii
PERNYATAAN	iv
KATA PENGANTAR	v
ABSTRAKSI	vii
ABSTRACTION	viii
DAFTAR ISI	ix
DAFTAR TABEL	xiii
DAFTAR GAMBAR	xvi
DAFTAR LAMPIRAN	xviii
BAB I PENDAHULUAN	1
1.1 Latar Belakang Masalah	1
1.2 Rumusan Masalah	11
1.3 Tujuan dan Manfaat Hasil Penelitian	12
BAB II Tinjauan Pustaka	13
2.1 Tinjauan Pustaka	13
2.1.1 Pasar Modal	13
2.1.2 Makro Ekonomi	14
2.1.3 Integrasi Pasar Modal Dunia	15
2.1.3 Faktor Dalam Negeri	15

2.1.4 Faktor Fudnamental Ekonomi Dalam Negeri	18
2.1.5 Faktor Fundamental ekonomi Luar Negeri	29
2.1.6 Faktor Aliran Dana.....	38
2.1.7 Penelitian Terdahulu	43
2.2 Kerangka Pemikiran Teoritis	46
2.3 Hipotesis	47
BAB III Metode Penelitian	49
3.1 Definisi Operasional Variabel	49
3.1.1 Variabel Dependen	49
3.1.2 Variabel Independen	49
3.2 Jenis dan Sumber Data	52
3.3 Populasi dan Sampel	53
3.4 Metode Pengumpulan Data	54
3.5 Teknik Analisis	54
3.5.1 Persamaan Garis Regresi	54
3.5.2 Uji Goodness of Fit 3.5.3 Uji Asumsi Klasik	56
3.5.3 Deteksi Asumsi Klasik	61
BAB IV GAMBARAN UMUM OBYEK PENELITIAN.....	65
4.1. Gambaran Umum Pasar Modal di Indonesia	65
4.2. Deskripsi Variabel Dependen (IHSG)	69
4.3. Deskripsi Variabel Independen Dalam Negeri	71
4.3.1. Inflasi.	71
4.3.2. Produk Domestik Bruto (PDB).....	73

4.3.3. Jumlah Uang Beredar (M2).....	75
4.3.4. Suku Bunga Bank Indonesia (SBI)	76
4.3.5. Kurs Mata Uang Rupiah Terhadap Dollar AS (Kurs \$).....	78
4.4. Deskripsi Variabel Independen Luar Negeri	80
4.4.1. Indeks <i>Dow Jones</i> (DJ)	80
4.4.2. Indeks <i>HangSeng</i> (HS).....	81
4.4.3. Harga Minyak Mentah Dunia (OIL)	83
4.4.4. Suku Bunga Bank Sentral Amerika Serikat / <i>Federal Reserve (The Fed)</i>	85
4.5. Deskripsi Variabel Independen Aliran Dana.....	87
4.5.1. Transaksi Berjalan/ <i>Current Account</i> (CUR).....	87
4.5.2. Transaksi Modal/ <i>Capital Account</i> (CAP)	88
4.5.3. <i>Net Buying</i> Asing (FRG)	90
BAB V HASIL DAN PEMBAHASAN / ANALISIS	92
5.1. Hasil Analisis Statistik Deskriptif	92
5.1.1. Deskripsi Variabel Penelitian Untuk Faktor Dalam Negeri...	92
5.1.2. Deskripsi Variabel Penelitian Untuk Faktor Luar Negeri.....	93
5.1.3. Deskripsi Variabel Penelitian Untuk Faktor Aliran Dana	95
5.2. Hasil Uji Faktor Dalam Negeri.....	96
5.2.1. Uji Asumsi Klasik Model Faktor Dalam Negeri	96
5.2.2. Hasil Uji Regresi untuk Faktor Dalam Negeri	103
5.3. Hasil Uji Faktor Luar Negeri	109
5.3.1. Uji Asumsi Klasik Model Faktor Luar Negeri.....	109

5.3.2. Hasil Uji Regresi Untuk Faktor Luar Negeri	116
5.4. Hasil Uji Faktor Aliran Dana	121
5.4.1. Uji Asumsi Klasik Model Faktor Aliran Dana	121
5.4.2. Hasil Uji Regresi untuk Faktor Aliran Dana.....	128
5.5. Intepretasi Hasil Penelitian Berdasarkan Variabel Pengaruh IHSG	133
5.5.1 Hasil Faktor Dalam Negeri	133
5.5.2. Hasil Faktor Luar Negeri	136
5.5.3. Hasil Faktor Aliran Dana	141
BAB VI PENUTUP	143
6.1. Kesimpulan	143
6.2. Saran	145
DAFTAR PUSTAKA	147
LAMPIRAN	