

DAFTAR ISI

PERNYATAAN ORISINALITAS SKRIPSI.....	iv
ABSTRACT.....	v
ABSTRAK.....	vi
KATA PENGANTAR	vii
DAFTAR ISI.....	x
DAFTAR TABEL.....	xiii
DAFTAR GAMBAR	xiv
BAB I PENDAHULUAN.....	1
1.1 Latar Belakang	1
1.2 Rumusan Masalah Penelitian.....	10
1.3 Tujuan Penelitian.....	12
1.3.1 Tujuan Umum	12
1.3.2 Tujuan Khusus.....	12
1.4 Manfaat Penelitian	13
1.4.1 Manfaat Teoretis.....	13
1.4.2 Manfaat Praktis	14
1.5 Sistematika Penulisan	14
BAB II TINJAUAN TEORITIS DAN PENELITIAN TERDAHULU	16
2.1 Teori Ekonomi Keuangan yang Menjadi Landasan Pikir	16
2.1.1 Teori Pasar Efisien (Efficient Market Hypothesis – EMH)	17
2.1.2 Arbitrage Pricing Theory (APT)	20
2.1.3 Teori Paritas Daya Beli dan Paritas Suku Bunga.....	22
2.2 Penelitian Terdahulu.....	25
2.3 Kesenjangan Penelitian (Research Gap)	46
2.4 Kerangka Pemikiran Penelitian.....	49
2.4.1 Keterkaitan Pasar Saham: Perspektif Teoritis	50
2.4.2 Temuan Empiris Terdahulu: Keterkaitan Global dan Pasar Saham Indonesia 51	
2.4.3 Keterkaitan IHSG dengan Faktor Global.....	52

2.4.4	Canonical Correlation Analysis (CCA).....	52
2.4.5	Kerangka Pemikiran Grafis.....	53
2.4.6	Model Penelitian Teoritis	54
2.5	Hipotesis Penelitian.....	55
BAB III METODE PENELITIAN.....		57
3.1	Pendekatan Penelitian	57
3.2	Jenis dan Sumber Data	57
3.3	Definisi Operasional Variabel	58
3.4	Teknik Analisis Data	60
3.4.1	Statistik Deskriptif	60
3.4.2	Uji Normalitas dengan Uji Kolmogorov–Smirnov (K–S)	66
3.4.3	Korelasi Spearman	68
3.4.4	Canonical Correlation Analysis (CCA).....	70
3.4.5	Contoh Interpretasi.....	81
3.4.6	Pengujian Linieritas dan Normalitas Multivariat.....	81
3.5	Software yang Digunakan	84
BAB IV ANALISIS DATA DAN HASIL ANALISIS		85
4.1	Perkembangan Variabel Penelitian: Statistik Deskriptif	85
4.1.1	Statistik Deskriptif Indeks Harga Saham Gabungan (IHSG).....	85
4.1.2	Statistik Deskriptif NYSE Composite (Amerika Serikat).....	87
4.1.3	Statistik Deskriptif FTSE All Share (Inggris)	89
4.1.4	Statistik Deskriptif TOPIX (Jepang)	90
4.1.5	Statistik Deskriptif Shanghai Composite (Cina)	91
4.1.6	Statistik Deskriptif MSCI Singapore (Singapura)	93
4.1.7	Inflasi Negara-Negara Terkait.....	93
4.1.8	Statistik Kurs Negara-negara Terkait Terhadap Rupiah.....	96
4.2	Uji Normalitas Data (Kolmogorov–Smirnov)	99
4.3	Korelasi Spearman	101
4.3.1	IHSG dengan Indeks Saham Global	101
4.3.2	IHSG dengan Inflasi Negara-negara lain	102
4.3.3	Korelasi IHSG dengan Nilai Tukar Negara-negara Lain	104
4.4	Uji normalitas multivariat dan Linieritas	105

4.5	Canonical Correlation Analysis (CCA).....	107
4.5.1	Hasil Canonical Correlation.....	108
4.5.2	Uji Signifikansi Wilks' Lambda	108
4.5.3	Canonical Loadings.....	109
4.5.4	Interpretasi:	110
4.6	Pembahasan Hasil Penelitian	115
4.6.1	Pembahasan Umum.....	115
4.6.2	Pembahasan Masing-masing komponen	117
BAB V PENUTUP.....		121
5.1	Kesimpulan	121
5.2	Rekomendasi	122
5.3	Keterbatasan Penelitian.....	124
DAFTAR PUSTAKA		125
LAMPIRAN.....		127
Lampiran 1. Data.....		127
Lampiran 2. Statistiek Deskriptif, Uji Normalitas dan Korelasi Spearman dengan SPSS		136
Lampiran 3. Uji Normalitas Multivariate, Linieritas, Canonical Correlation Analysis (CCA) dan Uji Wilks Lamda.....		147