

DAFTAR ISI

	Halaman
HALAMAN JUDUL	i
HALAMAN PERSETUJUAN	ii
HALAMAN PENGESAHAN KELULUSAN UJIAN.....	iii
PERNYATAAN ORISINALITAS	iv
MOTTO DAN PERSEMBAHAN.....	v
<i>ABSTRACT</i>	vi
ABSTRAK	vii
KATA PENGANTAR	viii
DAFTAR TABEL	xv
DAFTAR GAMBAR	xvi
DAFTAR LAMPIRAN.....	xvii
BAB I PENDAHULUAN	1
1.1 Latar Belakang Masalah.....	1
1.2 Rumusan Masalah.....	12
1.3 Tujuan dan Kegunaan Penelitian	13
1.3.1 Tujuan Penelitian.....	13
1.3.2 Kegunaan Penelitian	13
1.4 Sistematika Penulisan.....	14
BAB II TELAAH PUSTAKA.....	16
2.1 Landasan Teori	16

2.1.1	<i>Contagion Effect Theory</i>	16
2.1.2	Teori Pasar Kuat terhadap Pasar yang Lebih Lemah.....	16
2.1.3	Pasar Modal	17
2.1.4	Saham	17
2.1.5	<i>Return Saham</i>	18
2.1.6	Indeks Harga Saham	19
2.1.7	Eksposur Ekonomi (<i>Economic Exposure</i>).....	21
2.1.8	Pengukuran <i>Economic Exposure</i>	27
2.1.9	Harga Saham, Return Saham dan Dampak Perubahan Kurs terhadap Keduanya	28
2.1.10	Nilai Tukar	31
2.2	Penelitian Terdahulu	40
2.3	Kerangka Pemikiran Teoritis dan Perumusan Hipotesis.....	46
2.3.1	Hubungan antara Kurs dengan Return saham	46
2.3.2	Hubungan antara Return Pasar dengan Return Saham ...	49
2.4	Hipotesis.....	50
BAB III METODE PENELITIAN		51
3.1	Variabel Penelitian dan Definisi Operasional Variabel	51
3.1.1	Variabel Penelitian	51
3.1.2	Definisi Operasional Variabel	51
3.2	Populasi dan Sampel	54
3.3	Jenis dan Sumber Data	55
3.4	Metode Pengumpulan Data	56
3.5	Metode Analisis Data	57

3.5.1 Statistik Deskriptif.....	57
3.5.2 Pengujian Asumsi Klasik.....	57
3.5.2.1 Uji Normalitas	57
3.5.2.2 Uji Multikolinearitas.....	58
3.5.2.3 Uji Heteroskedastisitas	59
3.5.2.4 Uji Autokolerasi	59
3.6 Pengujian Hipotesis.....	60
3.6.1 Uji t-statistik.....	61
3.6.2 Uji F-statistik.....	62
3.6.3 Uji Determinasi (R^2)	63
BAB IV HASIL DAN PEMBAHASAN	64
4.1 Statistik Deskriptif	64
4.1.1 Deskripsi Return Saham	64
4.1.2 Deskripsi Return Pasar	68
4.1.3 Deskripsi Kurs Dollar.....	70
4.2 Hasil Analisis dan Pembahasan	72
4.2.1 Hasil Uji Asumsi Klasik	72
4.2.1.1 Uji Normalitas.....	72
4.2.1.2 Uji Multikolinearitas.....	73
4.2.1.3 Uji Heteroskedastisitas	74
4.2.1.4 Uji Autokolerasi	75
4.2.2 Perumusan Model Analisis Regresi	76
4.2.3 Pengujian Hipotesis.....	78

4.2.3.1 Pengujian Secara Parsial (Uji t)	78
4.2.3.2 Pengujian Koefisien Regresi Simultan (Uji F)	79
4.2.3.3 Pengujian Koefisien Determinasi (Adjusted R ²)	80
4.2.4 Pembahasan	81
BAB V PENUTUP	85
5.1 Kesimpulan	85
5.2 Keterbatasan Penelitian	85
5.3 Saran	86
DAFTAR PUSTAKA	88
LAMPIRAN	91