

DAFTAR ISI

Halaman

SURAT PERNYATAAN KARYA SENDIRI	i
LEMBAR PENGESAHAN SKRIPSI	ii
ABSTRAK	iii
ABSTRACT	iv
KATA PENGANTAR.....	v
DAFTAR ISI.....	vii
DAFTAR TABEL.....	x
DAFTAR GAMBAR	xi
DAFTAR LAMPIRAN	xii
BAB I PENDAHULUAN	1
A. Latar Belakang Penelitian	1
B. Rumusan Masalah	8
C. Tujuan Penelitian.....	9
D. Kontribusi Penelitian.....	10
BAB II KAJIAN PUSTAKA DAN PENGEMBANGAN HIPOTESIS	12
A. Kajian Pustaka.....	12
1. Manajemen Investasi	12
a. Pengertian Manajemen Investasi	12
b. Proses Manajemen Investasi	13
c. Jenis Investasi	14
d. Tujuan Investasi	15
2. Pasar Modal	16
a. Pengertian Pasar Modal	16
b. Instrumen Pasar Modal	16
c. Para Pemain di Pasar Modal	17
3. Globalisasi	18
a. Pengertian Globalisasi.....	18
b. Faktor-faktor yang mewujudkan Globalisasi.....	18

c. Kebaikan dan Keburukan Globalisasi.....	19
4. Indeks Harga Saham Gabungan (IHSG)	20
5. Indeks Dow Jones Industrial Average (DJIA).....	26
6. Indeks Hang Seng (HSI).....	28
7. Indeks Strait Times (STI)	29
8. Penelitian Terdahulu.....	30
B. Pengembangan Hipotesis.....	35
1. Pengaruh Indeks Dow Jones Industrial Average (DJIA) terhadap Indeks Harga Saham Gabungan (IHSG)	35
2. Pengaruh Indeks Hang Seng (HSI) terhadap Indeks Harga Saham Gabungan (IHSG).....	37
3. Pengaruh Indeks Strait Times (STI) terhadap Indeks Harga Saham Gabungan (IHSG).....	38
BAB III METODE PENELITIAN	41
A. Waktu dan Tempat Penelitian	41
B. Desain Penelitian.....	41
C. Definisi dan Operasionalisasi Variabel	42
1. Definisi Naratif.....	42
2. Operasionalisasi Variabel.....	45
D. Skala Pengukuran Variabel	46
E. Populasi dan Sampel Penelitian.....	46
F. Metode Pengumpulan Data.....	47
G. Metode Analisis Data	48
1. Uji Stasioneritas.....	48
a. Uji Akar Unit (<i>Unit Root Test</i>)	50
b. Uji Derajat Integrasi.....	52
2. Uji Kointegrasi	53
3. Estimasi ECM	54
4. Uji Kelayakan Model	55
a. Koefisien Determinasi (R^2).....	55
b. Uji Signifikansi Simultan (Uji F-Statistik)	56
5. Uji Hipotesis.....	57

a. Uji Parsial (Uji t-Statistik)	57
BAB IV HASIL DAN PEMBAHASAN.....	58
A. Gambaran Umum Obyek Penelitian	58
1. Indeks Harga Saham Gabungan (IHSG)	58
2. Indeks Dow Jones Industrial Average (DJIA).....	59
3. Indeks Hang Seng (HSI).....	60
4. Indeks Strait Times (STI)	61
B. Analisis Data	62
1. Hasil Uji Stasioneritas	62
2. Hasil Uji Kointegrasi	64
3. Hasil Estimasi ECM	66
a. Analisis Jangka Panjang.....	66
b. Analisis Jangka Pendek	68
4. Hasil Uji Kelayakan Model	70
a. Koefisien Determinasi (R^2)	70
b. Uji Signifikansi Simultan (Uji F-Statistik)	70
5. Hasil Uji Hipotesis	71
a. Uji Parsial (Uji t-Statistik)	71
C. Pembahasan Hasil Penelitian.....	73
1. Pengaruh Indeks Dow Jones Industrial Average (DJIA) terhadap Indeks Harga Saham Gabungan (IHSG)	73
2. Pengaruh Indeks Hang Seng (HSI) terhadap Indeks Harga Saham Gabungan (IHSG).....	75
3. Pengaruh Indeks Strait Times (STI) terhadap Indeks Harga Saham Gabungan (IHSG).....	76
BAB V SIMPULAN DAN SARAN.....	78
A. Simpulan.....	78
B. Saran	79
DAFTAR PUSTAKA	81
LAMPIRAN.....	87