

## DAFTAR ISI

<b>HALAMAN JUDUL</b> .....	i
<b>LEMBAR PERNYATAAN</b> .....	ii
<b>HALAMAN PERSETUJUAN</b> .....	iii
<b>HALAMAN PENGESAHAN</b> .....	iv
<b>RIWAYAT HIDUP</b> .....	v
<b>MOTTO</b> .....	vi
<b>PERSEMBAHAN</b> .....	vii
<b>ABSTRAK</b> .....	viii
<b>KATA PENGANTAR</b> .....	x
<b>DAFTAR ISI</b> .....	xii
<b>DAFTAR TABEL</b> .....	xvi
<b>DAFTAR GAMBAR</b> .....	xvii

### **BAB I PENDAHULUAN**

1.1. Latar Belakang .....	1
1.2. Ruang Lingkup Penelitian .....	7
1.3. Rumusan Masalah .....	7
1.4. Tujuan Masalah .....	8
1.5. Manfaat Penelitian .....	8
1.6. Sistematika Penulisan .....	9

### **BAB II LANDASAN TEORI**

2.1. <i>Contagion Effect Theory</i> (Efek Domino) .....	11
2.2. Indeks Harga Saham Gabungan (IHSG) .....	13
2.3. <i>Kuala Lumpur Stock Exchange</i> (KLSE) .....	15
2.4. <i>Strait Time Index</i> (STI) .....	15
2.5. <i>Stock Exchange of Thailand Index</i> (SETI) .....	16
2.6. <i>Philippine Stock Exchange Index</i> (PSEI) .....	16
2.7. <i>Vietnam Ho Chi Minh Stock Index</i> (VNI) .....	16
2.8. Penelitian Terdahulu .....	17

2.9. Kerangka Pemikiran.....	19
2.10 Bangunan Hipotesis .....	20
2.10.1 Pengaruh <i>Kuala Lumpur Stock Exchange</i> (KLSE) Terhadap Indeks Harga Saham Gabungan (IHSG) di BEI .....	20
2.10.2 Pengaruh <i>Strait Time Index</i> (STI) Terhadap Indeks Harga Saham Gabungan (IHSG) di BEI .....	20
2.10.3 Pengaruh <i>Stock Exchange of Thailand Index</i> (SETI) Terhadap Indeks Harga Saham Gabungan (IHSG) di BEI .....	21
2.10.4 Pengaruh <i>Philippine Stock Exchange Index</i> (PSEI) Terhadap Indeks Harga Saham Gabungan (IHSG) di BEI .....	21
2.10.5 Pengaruh <i>Vietnam Ho Chi Minh Stock Index</i> (VNI) Terhadap Indeks Harga Saham Gabungan (IHSG) di BEI .....	22

### **BAB III METODE PENELITIAN**

3.1 Sumber Data.....	23
3.2 Metode Pengumpulan Data .....	23
3.3 Populasi dan Sampel .....	24
3.3.1 Populasi .....	24
3.3.2 Sampel .....	24
3.4 Variabel Penelitian dan Definisi Operasional Variabel .....	25
3.4.1 Variabel Penelitian .....	25
3.4.2 Definisi Operasional Variabel .....	25
3.4.2.1 Variabel Dependen (Y) .....	25
3.4.2.2 Variabel Independen (X) .....	26
3.5 Metode Analisis Data.....	28
3.5.1 Statistik Deskriptif.....	28
3.5.2 Pengujian Asumsi Klasik .....	29
3.5.2.1 Uji Normalitas .....	29
3.5.2.2 Uji Multikolinearitas.....	30
3.5.2.3 Uji Autokorelasi.....	30
3.5.2.4 Uji Heteroskedastisitas .....	31
3.5.3 Analisis Regresi Linier Berganda.....	31

3.6 Pengujian Hipotesis .....	32
3.6.1 Koefisien Determinasi ( $R^2$ ) .....	32
3.6.2 Uji F.....	33
3.6.3 Uji T.....	33

## **BAB IV HASIL DAN PEMBAHASAN**

4.1 Deskripsi Data.....	35
4.1.1 Deskripsi Objek Penelitian .....	35
4.1.2 Deskripsi Variabel Penelitian.. .....	36
4.2 Hasil Analisis Data.....	36
4.2.1 Analisis Deskriptif .....	36
4.2.2 Uji Asumsi Klasik.....	39
4.2.2.1 Uji Normalitas Data.....	39
4.2.2.2 Uji Multikolinearitas.....	40
4.2.2.3 Uji Autokorelasi .....	41
4.2.2.4 Uji Heteroskedatisitas.....	42
4.2.3 Analisis Regresi Linear Berganda.....	43
4.3 Hasil Pengujian Hipotesis .....	45
4.3.1 Koefisien Determinasi ( $R^2$ ) .....	45
4.3.2 Uji F .....	46
4.3.3 Uji T .....	47
4.4 Pembahasan.....	48
4.4.1 Pengaruh <i>Kuala Lumpur Stock Exchange (KLSE)</i> Terhadap Indeks Harga Saham Gabungan (IHSG) di BEI .....	48
4.4.2 Pengaruh <i>Starit Times Index (STI)</i> Terhadap Indeks Harga Saham Gabungan (IHSG) di BEI .....	49
4.4.3 Pengaruh <i>Stock Exchange of Thailand Index (SETI)</i> Terhadap Indeks Harga Saham Gabungan (IHSG) di BEI .....	50
4.4.4 Pengaruh <i>Philippine Stock Exchange Index (PSEI)</i> Terhadap Indeks Harga Saham Gabungan (IHSG) di BEI .....	50
4.4.5 Pengaruh <i>Vietnam Ho Chi Minh Stock Index (VNI)</i> Terhadap Indeks Harga Saham Gabungan (IHSG) di BEI .....	51

**BAB V SIMPULAN DAN SARAN**

5.1 Simpulan .....53  
5.2 Saran.....54

**DAFTAR PUSTAKA**

**LAMPIRAN**