



Daftar Isi

Halaman Judul	i
Halaman Pengesahan	ii
Halaman Pernyataan	iii
Kata Pengantar	iv
Daftar Isi	vi
Daftar Tabel	viii
Intisari	ix
<i>Abstract</i>	x
Bab I Pendahuluan	1
1.1. Latar Belakang Masalah	1
1.2. Perumusan Masalah	7
1.3. Tujuan Penelitian	8
1.4. Manfaat Penelitian	8
1.5. Sistematika Penulisan	9
Bab II Landasan Teori	10
2.1. Tinjauan Pustaka	10
2.2. Landasan Teori	13
2.2.1. Return	13
2.2.2. Harga Minyak Dunia	14
2.2.3. Kurs Mata Uang	17
2.2.4. Tingkat Suku Bunga	23
2.2.5. Model Skematik	25
Bab III Metode Penelitian	26
3.1. Data dan Sumber Data	26
3.2. Pengolahan Data dan Model Penelitian	26



3.3. Prosedur Analisis Data dan Tes Hipotesis	28
3.3.1 Pengujian Asumsi Klasik	28
3.3.2 Pengujian Hipotesis	31
Bab IV Hasil Analisis dan Pembahasan	32
4.1. Hasil Uji Asumsi Klasik	33
4.2. Analisis Regresi Berganda	35
4.3. Hasil Uji Statistik	37
4.3.1. Hasil Uji F	37
4.3.2. Hasil Uji t	38
4.3.3. R^2	41
4.4. Analisis Regresi Berganda dengan Interaksi	42
Variabel Dummy saat Periode <i>Bearish</i> dan <i>Bullish</i>	
Bab V Kesimpulan	50
Daftar Pustaka	52
Lampiran	



DAFTAR TABEL

1.	Tabel 1. Uji Statistik Durbin Watson	30
2.	Tabel 2. Hasil Uji Heteroskedastisitas	35
3.	Tabel 3. Hasil Estimasi variabel makroekonomi yang mempengaruhi Return Saham di Indonesia pada Periode Januari 1999- Desember 2007	36
4.	Tabel 4. Hasil Estimasi variabel-variabel yang mempengaruhi Return Saham di Indonesia pada Periode <i>Bearsih</i> dan <i>Bullish</i>	43