

DAFTAR ISI

ABSTRACT	i
ABSTRAK	ii
LEMBAR PERNYATAAN	iii
LEMBAR PENGESAHAN	iv
KATA PENGANTAR	v
DAFTAR TABEL	x
DAFTAR LAMPIRAN	xii
BAB I PENDAHULUAN	1
1.1. LATAR BELAKANG MASALAH.....	1
1.2. IDENTIFIKASI, RUMUSAN, DAN BATASAN MASALAH.....	12
1.2.1. Identifikasi Masalah	12
1.2.2. Rumusan Masalah	12
1.2.3. Batasan Masalah.....	13
1.3. MAKSUD DAN TUJUAN PENELITIAN	13
1.3.1. Maksud Penelitian	13
1.3.2. Tujuan Penelitian.....	13
1.4. MANFAAT DAN KEGUNAAN PENELITIAN.....	14
1.4.1. Manfaat Penelitian.....	14
1.4.2. Kegunaan Penelitian.....	15
BAB II KAJIAN PUSTAKA, KERANGKA PEMIKIRAN DAN HIPOTESIS	16
2.1. KAJIAN TEORI	16
2.1.1. Efficient Market Hypothesis	17
2.1.2. Market Capitalization	20
2.1.3. Teori Pergerakan Saham.....	22
2.1.4. Arbitrase Pricing Theory (APT).....	26
2.1.5. Indeks LQ45.....	29
2.1.6. Nilai Tukar Rupiah Terhadap Dollar.....	31

2.1.7. Suku Bunga Sertifikat Bank Indonesia	32
2.1.8. Inflasi	34
2.1.9. Harga Minyak Dunia	34
2.2. PENELITIAN TERDAHULU	35
2.3. KERANGKA PEMIKIRAN	42
2.4. HIPOTESIS	43
2.4.1. Hipotesis 1 Nilai Tukar Rupiah Terhadap Indeks Harga Saham LQ45	43
2.4.2. Hipotesis 2 Suku Bunga SBI Terhadap Indeks Harga Saham LQ45	44
2.4.3. Hipotesis 3 Tingkat Inflasi Terhadap Indeks Harga Saham LQ45	45
2.4.4. Hipotesis 4 Harga minyak Dunia Terhadap Indeks Harga Saham LQ45	46
BAB III METODE PENELITIAN.....	47
3.1. JENIS DAN DESAIN PENELITIAN	47
3.2. VARIABEL PENELITIAN	47
3.2.1. Definisi Konsep	48
3.2.2. Definisi Operasional dan Pengukuran Variabel	49
3.3. POPULASI DAN SAMPEL	50
3.4. JENIS DAN SUMBER DATA	51
3.5. METODE PENGUMPULAN DATA	52
3.6. METODE ANALISIS DATA	53
3.6.1. Analisis Deskriptif	54
3.6.2. Uji Asumsi Klasik	55
3.6.3. Uji Hipotesis	58
BAB IV HASIL PENELITIAN DAN PEMBAHASAN.....	60
4.1. DESKRIPSI PERUSAHAAN	60
4.1.1. Sejarah Indeks Harga Saham LQ45	60
4.1.2. Ruang Lingkup Indeks Harga Saham LQ45	60

4.2. HASIL PENELITIAN.....	61
4.2.1. Analisis Deskriptif.....	61
4.2.3. Uji Asumsi Klasik	67
4.2.4. Uji Hipotesis	75
4.3. PEMBAHASAN HASIL PENELITIAN	80
4.3.1. Pengaruh Nilai Tukar Terhadap Indeks Harga Saham LQ45	80
4.3.2. Pengaruh Suku Bunga SBI Terhadap Indeks Harga Saham LQ45	81
4.3.3. Pengaruh Inflasi Terhadap Indeks Harga Saham LQ45	82
4.3.4. Pengaruh Harga Minyak Dunia Terhadap Indeks Harga Saham LQ45	83
BAB V KESIMPULAN DAN SARAN	85
5.1. KESIMPULAN.....	85
5.2. SARAN	86
DAFTAR PUSTAKA	88
LAMPIRAN	92
DAFTAR RIWAYAT HIDUP	99



 UNIVERSITAS
 MERCU BUANA