

## DAFTAR ISI

	Halaman
<b>HALAMAN JUDUL</b>	i
<b>SURAT PERNYATAAN KARYA SENDIRI</b>	ii
<b>LEMBAR PENGESAHAN SKRIPSI</b>	iii
<b>ABSTRAK</b>	iv
<b>ABSTRACT</b>	v
<b>KATA PENGANTAR</b>	vi
<b>DAFTAR ISI</b>	viii
<b>DAFTAR TABEL</b>	xii
<b>DAFTAR GAMBAR</b>	xiii
<b>DAFTAR LAMPIRAN</b>	xiv
<b>BAB I PENDAHULUAN</b>	
A. Latar Belakang Penelitian	1
B. Rumusan Masalah Penelitian	11
C. Tujuan dan Kontribusi Penelitian	11
1. Tujuan Penelitian	11
2. Kontribusi Penelitian	12
<b>BAB II KAJIAN PUSTAKA DAN PENGEMBANGAN HIPOTESIS</b>	
A. Kajian Pustaka	13
1. Teori Sinyal ( <i>Signalling Theory</i> )	13
2. Jakarta Islamic Index (JII)	14
a. Pengertian Jakarta Islamic Index (JII)	14
b. Faktor yang Mempengaruhi Indeks Harga Saham	15
3. Volatilitas Harga Saham ( <i>Stock Price Volatility</i> )	17
a. Pengertian Volatilitas Harga Saham	17
b. Jenis-jenis Volatilitas Harga Saham	18

c. Metode Perhitungan Volatilitas Harga Saham	19
d. Faktor-faktor yang Mempengaruhi Volatilitas Harga Saham	20
4. Inflasi	22
a. Pengertian Inflasi	22
b. Jenis-jenis Inflasi	23
c. Pengukuran Tingkat Inflasi	25
d. Faktor Penyebab Inflasi	27
5. Suku Bunga	28
a. Pengertian Suku Bunga	28
b. Faktor-faktor yang Mempengaruhi Suku Bunga	29
6. Nilai Tukar	31
a. Pengertian Nilai Tukar	31
b. Macam-macam Kurs	31
c. Faktor-faktor yang Mempengaruhi Kurs	32
7. Penelitian Terdahulu	33
8. Rerangka Konseptual	37
B. Pengembangan Hipotesis	38
1. Pengaruh Inflasi Terhadap Volatilitas Harga Saham	38
2. Pengaruh Suku Bunga Terhadap Volatilitas Harga Saham	39
3. Pengaruh Nilai Tukar Terhadap Volatilitas Harga Saham	40

### **BAB III METODE PENELITIAN**

A. Waktu dan Tempat Penelitian	42
B. Desain Penelitian	42
C. Definisi dan Operasional Variabel Penelitian	43
1. Volatilitas Harga Saham	43
2. Inflasi	44
3. Suku Bunga	44
2. Nilai Tukar	45

D. Populasi dan Sampel Penelitian	46
1. Populasi Penelitian	46
2. Sampel Penelitian	46
E. Teknik Pengumpulan Data	46
F. Metode Analisis Data	47
1. Analisis Statistik Deskriptif	48
2. Uji Stasioneritas	48
3. Uji Heteroskedastisitas	49
4. Uji Autokorelasi	50
5. Uji Multikolinearitas	50
6. Analisis Regresi Linear Berganda	51
7. Uji Hipotesis	52
a. Uji Koefisien Determinasi (Uji $R^2$ )	52
b. Uji Signifikansi Simultan (Uji Statistik F)	53
c. Uji Signifikansi Parameter Individual (Uji Statistik t)	54

#### **BAB IV HASIL DAN PEMBAHASAN**

A. Gambaran Umum Objek Penelitian	56
B. Hasil Analisis Statistik Deskriptif	57
C. Hasil Uji Stasioneritas Data	59
1. Uji Stasioner Volatilitas Harga Saham	59
2. Uji Stasioner Inflasi	60
3. Uji Stasioner Suku Bunga	60
4. Uji Stasioner Nilai Tukar	61
D. Hasil Uji Heteroskedastisitas	61
E. Hasil Uji Autokorelasi	62
F. Hasil Uji Multikolinearitas	63
G. Hasil Analisis Regresi Linear Berganda	63
H. Hasil Uji Hipotesis	66

1. Hasil Uji Koefisien Determinasi (Uji $R^2$ )	66
2. Hasil Uji Signifikansi Simultan (Uji Statistik F)	66
3. Hasil Uji Signifikansi Parameter Individual (Uji Statistik t)	67
I. Pembahasan Hasil Penelitian	70
1. Pengaruh Inflasi Terhadap Volatilitas Harga Saham	70
2. Pengaruh Suku Bunga Terhadap Volatilitas Harga Saham	71
3. Pengaruh Nilai Tukar Terhadap Volatilitas Harga Saham	72
<b>BAB V SIMPULAN DAN SARAN</b>	
A. Simpulan	74
B. Saran	74
<b>DAFTAR PUSTAKA</b>	76
<b>LAMPIRAN</b>	81



UNIVERSITAS  
MERCU BUANA