

DAFTAR ISI

ABSTRACT	i
ABSTRAK	ii
PENGESAHAN	iii
PERYATAAN	iv
KATA PENGANTAR	v
DAFTAR ISI	viii
DAFTAR TABEL	xv
DAFTAR GAMBAR	xx
DAFTAR SINGKATAN	xxi
DAFTAR LAMPIRAN	xxii
BAB I - PENDAHULUAN	
1.1. Latar belakang	1
1.2. Perumusan masalah	6
1.3. Maksud dan tujuan	6
1.4. Manfaat dan kegunaan	7
1.5. Batasan masalah	7
1.6. Sistematika penulisan	7
BAB II – DESKRIPSI PERUSAHAAN	
2.1. Bursa Efek Indonesia	10
2.2. Bank Indonesia	23
BAB III – KAJIAN PUSTAKA DAN HIPOTESIS	
3.1. Kajian pustaka penelitian sebelumnya	28
3.2. Tingkat suku bunga	30
3.2.1. Sertifikasi Bank Indonesia	31
3.2.2. Hubungan tingkat suku bunga dan harga saham	31

3.3.	Inflasi	34
3.3.1.	Hubungan inflasi dan harga saham	37
3.4.	Nilai Tukar	38
3.4.1.	Hubungan nilai tukar dan harga saham	43
3.5.	Saham	44
3.5.1.	Harga saham	46
3.6.	Indeks harga saham	49
3.7.	Hipotesis	51
3.8.	Kerangka pemikiran	53

BAB IV – METODOLOGI PENELITIAN

4.1.	Obyek Penelitian	54
4.2.	Metode Penelitian	54
4.2.1.	Identifikasi variabel dan pengukuran	54
4.2.2.	Definisi operasional variabel	55
4.3.	Populasi penelitian	57
4.4.	Metode Pengumpulan data	57
4.5.	Metode analisa data	58
4.5.1.	Uji Asumsi Klasik	58
4.5.1.1.	Uji Normalitas	59
4.5.1.2.	Uji Multikolinearitas	60
4.5.1.3.	Uji Autokorelasi	60
4.5.1.4.	Uji Heteroskedastisitas	63
4.5.2.	Regresi Linear Berganda (<i>multiple regression model</i>)	65
4.5.3.	Koefisien Determinasi (uji R^2)	65
4.5.4.	Analisa Varians Fisher / Pengujian simultan (Uji F)	67
4.5.5.	Analisa <i>Test of Significance</i> / Pengujian Parsial (Uji t)	68

BAB V - ANALISA PEMBAHASAN

5.1	Indeks Harga Saham Sektor Pertanian (Y_1)	71
5.1.1	Uji Asumsi Klasik	72

5.1.1.1	Uji Normalitas	72
5.1.1.2	Uji Multikolinieritas	72
5.1.1.3	Uji Autokorelasi	74
5.1.1.4	Uji Heteroskedastisitas	75
5.1.2	Persamaan Regresi Linier Berganda	76
5.1.3	Analisis Koefisien Determinasi	77
5.1.4	Pengujian Simultan (Uji F)	78
5.1.5	Pengujian Parsial (Uji t)	79
5.2	Indeks Harga Saham Sektor Pertambangan (Y_2)	80
5.2.1	Uji Asumsi Klasik	80
5.2.1.1	Uji Normalitas	80
5.2.1.2	Uji Multikolinieritas	81
5.2.1.3	Uji Autokorelasi	82
5.2.1.4	Uji Heteroskedastisitas	83
5.2.2	Persamaan Regresi Linier Berganda	85
5.2.3	Analisis Koefisien Determinasi	86
5.2.4	Pengujian Simultan (Uji F)	87
5.2.5	Pengujian Parsial (Uji t)	87
5.3	Indeks Harga Saham Sektor Industri Dasar dan Kimia (Y_3)	88
5.3.1	Uji Asumsi Klasik	89
5.3.1.1	Uji Normalitas	89
5.3.1.2	Uji Multikolinieritas	89
5.3.1.3	Uji Autokorelasi	91
5.3.1.4	Uji Heteroskedastisitas	92
5.3.2	Persamaan Regresi Linier Berganda	93
5.3.3	Analisis Koefisien Determinasi	94
5.3.4	Pengujian Simultan (Uji F)	95
5.3.5	Pengujian Parsial (Uji t)	96
5.4	Indeks Harga Saham Sektor Aneka Industri (Y_4)	97

5.4.1	Uji Asumsi Klasik	97
5.4.1.1	Uji Normalitas	97
5.4.1.2	Uji Multikolinieritas	98
5.4.1.3	Uji Autokorelasi	99
5.4.1.4	Uji Heteroskedastisitas	100
5.4.2	Persamaan Regresi Linier Berganda	102
5.4.3	Analisis Koefisien Determinasi	103
5.4.4	Pengujian Simultan (Uji F)	104
5.4.5	Pengujian Parsial (Uji t)	104
5.5	Indeks Harga Saham Sektor Industri Barang Konsumsi (Y_5)	105
5.5.1	Uji Asumsi Klasik	105
5.5.1.1	Uji Normalitas	105
5.5.1.2	Uji Multikolinieritas	106
5.5.1.3	Uji Autokorelasi	108
5.5.1.4	Uji Heteroskedastisitas	109
5.5.2	Persamaan Regresi Linier Berganda	111
5.5.3	Analisis Koefisien Determinasi	112
5.5.4	Pengujian Simultan (Uji F)	112
5.5.5	Pengujian Parsial (Uji t)	113
5.6	Indeks Harga Saham Sektor Property dan Real Estate (Y_6)	114
5.6.1	Uji Asumsi Klasik	114
5.6.1.1	Uji Normalitas	114
5.6.1.2	Uji Multikolinieritas	115
5.6.1.3	Uji Autokorelasi	116
5.6.1.4	Uji Heteroskedastisitas	118
5.6.2	Persamaan Regresi Linier Berganda	119
5.6.3	Analisis Koefisien Determinasi	120
5.6.4	Pengujian Simultan (Uji F)	121
5.6.5	Pengujian Parsial (Uji t)	122

5.7	Indeks Harga Saham Sektor Transportasi dan Infrastruktur (Y ₇)	123
5.7.1	Uji Asumsi Klasik	123
5.7.1.1	Uji Normalitas	123
5.7.1.2	Uji Multikolinieritas	124
5.7.1.3	Uji Autokorelasi	125
5.7.1.4	Uji Heteroskedastisitas	126
5.7.2	Persamaan Regresi Linier Berganda	128
5.7.3	Analisis Koefisien Determinasi	129
5.7.4	Pengujian Simultan (Uji F)	130
5.7.5	Pengujian Parsial (Uji t)	130
5.8	Indeks Harga Saham Sektor Keuangan (Y ₈)	131
5.8.1	Uji Asumsi Klasik	131
5.8.1.1	Uji Normalitas	131
5.8.1.2	Uji Multikolinieritas	132
5.8.1.3	Uji Autokorelasi	133
5.8.1.4	Uji Heteroskedastisitas	135
5.8.2	Persamaan Regresi Linier Berganda	136
5.8.3	Analisis Koefisien Determinasi	137
5.8.4	Pengujian Simultan (Uji F)	138
5.8.5	Pengujian Parsial (Uji t)	139
5.9	Indeks Harga Saham Sektor Perdagangan, Jasa & Investasi (Y ₉)	140
5.9.1	Uji Asumsi Klasik	140
5.9.1.1	Uji Normalitas	140
5.9.1.2	Uji Multikolinieritas	141
5.9.1.3	Uji Autokorelasi	142
5.9.1.4	Uji Heteroskedastisitas	143
5.9.2	Persamaan Regresi Linier Berganda	145
5.9.3	Analisis Koefisien Determinasi	146
5.9.4	Pengujian Simultan (Uji F)	146

5.9.5	Pengujian Parsial (Uji t)	147
5.10	Analisis Regresi Indeks Harga Saham Sektor Manufaktur (Y_{10})	148
5.10.1	Uji Asumsi Klasik	148
5.10.1.1	Uji Normalitas	148
5.10.1.2	Uji Multikolinieritas	149
5.10.1.3	Uji Autokorelasi	150
5.10.1.4	Uji Heteroskedastisitas	152
5.10.2	Persamaan Regresi Linier Berganda	154
5.10.3	Analisis Koefisien Determinasi	155
5.10.4	Pengujian Simultan (Uji F)	155
5.10.5	Pengujian Parsial (Uji t)	156
5.11	Pembahasan	157
BAB VI - KESIMPULAN DAN REKOMENDASI		
6.1.	Kesimpulan	161
6.2.	Rekomendasi	162
DAFTAR PUSTAKA		
LAMPIRAN		165
RIWAWAT HIDUP		179