

DAFTAR ISI

LEMBAR PERSETUJUAN	i
PERNYATAAN BEBAS PLAGIAT	ii
ABSTRAK	iii
ABSTRACT	iv
KATA PENGANTAR	v
DAFTAR ISI	vii
DAFTAR GAMBAR	x
DAFTAR TABEL	xi
DAFTAR LAMPIRAN	xii
BAB I PENDAHULUAN	1
1.1 Latar Belakang.....	1
1.2 Rumusan Masalah.....	14
1.3 Tujuan Penelitian.....	15
1.4 Manfaat Penelitian.....	16
1.4.1 Manfaat Teoritis	16
1.4.2 Manfaat Praktis.....	16
BAB II KAJIAN TEORITIK	18
2.1 Teori Pendukung.....	18
2.1.1. Teori Sinyal (<i>Signaling Theory</i>).....	18
2.1.2. <i>Return Saham</i>	19
2.1.3. Indeks Harga Saham Gabungan (IHSG)	20
2.1.4. <i>Foreign Direct Investment (FDI)</i>	20
2.1.5. Harga Minyak Dunia	21
2.1.6. Suku Bunga (<i>BI Rate</i>).....	22

2.1.7. Nilai Tukar	23
2.2 Kerangka Teori dan Pengembangan hipotesis	24
2.2.1. Hubungan <i>Foreign Direct Investment</i> (FDI) dan <i>Return</i> Indeks Harga Saham Gabungan (IHSG).....	24
2.2.2. Hubungan harga minyak dunia dan <i>Return</i> Indeks Harga Saham Gabungan (IHSG)	25
2.2.3. Hubungan suku bunga (<i>BI Rate</i>) dan <i>Return</i> Indeks Harga Saham Gabungan (IHSG)	26
2.2.4. Hubungan nilai tukar (<i>Exchange Rate</i>) dan <i>Return</i> Indeks Harga Saham Gabungan (IHSG).....	27
2.2.5. Kerangka Berpikir	29
2.2.6. Penelitian Terdahulu.....	30
BAB III METODOLOGI PENELITIAN	39
3.1 Objek dan Ruang Lingkup Penelitian.....	39
3.2 Teknik Pengumpulan Data	40
3.3 Operasionalisasi Variabel	41
3.3.1. Variabel Terikat (<i>Dependent Variable</i>).....	41
3.3.2. Variabel Bebas (<i>Independent Variables</i>).....	42
3.3.3. Variabel Kontrol.....	44
3.4 Teknik Analisis.....	47
3.4.1. Statistik Deskriptif.....	47
3.4.2. Analisis Regresi Linier Berganda.....	47
3.4.3. Uji Asumsi Klasik	48
3.4.4. Uji Koefisien Determinasi	51
3.4.5. Uji Hipotesis (Uji t).....	51
3.4.6. Uji Simultan (Uji F)	52
3.4.7. Uji Kekokohan Model (<i>Robustness Test</i>)	53

BAB IV HASIL DAN PEMBAHASAN	52
4.1 Statistik Deskriptif.....	52
4.2 Uji Asumsi klasik	59
4.2.1 Normalitas	59
4.2.2 Multikolinieritas	60
4.2.3 Heterokedastisitas.....	61
4.2.4 Autokorelasi	62
4.3 Uji Koefisien Determinasi	63
4.4 Uji Signifikansi Hipotesis Parsial (uji T).....	64
4.5 Uji Simultan (Uji F).....	75
4.6 Uji Kekokohan Model (<i>Robustness Test</i>)	76
4.7 Analisis Hasil Periode Sebelum (2018- Februari 2020) dan Saat Covid-19 (Maret 2020-Desember 2022)	78
4.7.1 Periode Sebelum Covid-19 (Januari 2018-Februari 2020).....	78
4.7.2 Periode Saat Covid-19 (Maret 2020-Desember 2022)	81
BAB V KESIMPULAN, IMPLIKASI, DAN SARAN	84
5.1 Kesimpulan.....	84
5.2 Implikasi	86
5.3 Keterbatasan penelitian.....	87
5.4 Saran.....	87
DAFTAR PUSTAKA	89
LAMPIRAN.....	96

DAFTAR GAMBAR

Gambar	Judul	Halaman
1.1	Pergerakan Indeks Harga Saham Gabungan (IHSG) Tahun 2018-2022	2
1.2	Pergerakan Harga Minyak Dunia Brent	6
1.3	Pergerakan Nilai Tukar Dolar Amerika Serikat Terhadap Rupiah	14
2.1	Bagan Kerangka Pemikiran	29
4.1	Uji Normalitas	59



*Mencerdaskan dan
Memartabatkan Bangsa*

DAFTAR TABEL

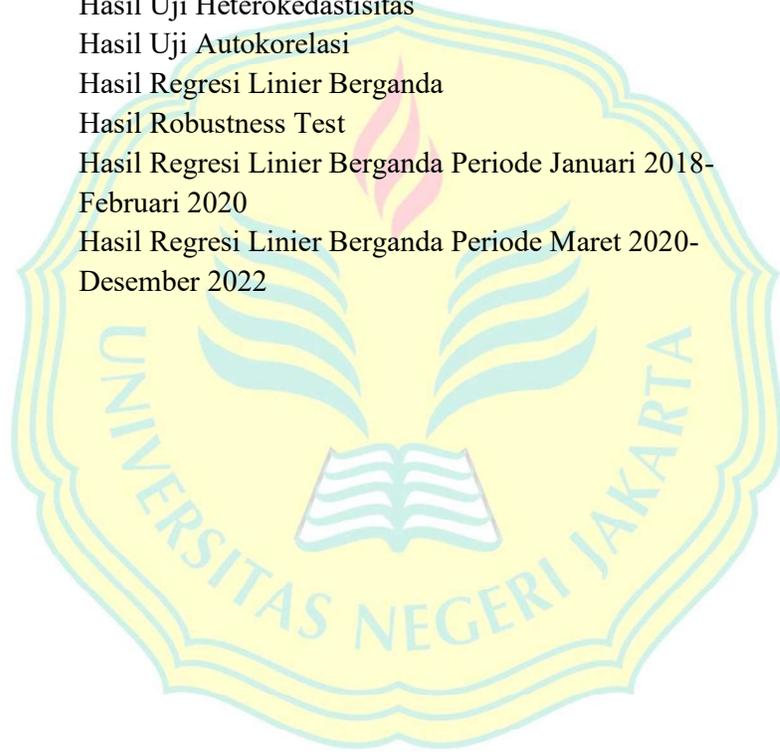
Tabel	Judul	Halaman
2.1	Penelitian Terdahulu	30
3.1	Sampel Penelitian	40
3.2	Operasionalisasi Variabel Penelitian	46
4.1	Statistik Deskriptif Variabel Penelitian	52
4.2	Hasil Uji Multikolinieritas	60
4.3	Hasil Uji Heterokedastisitas	62
4.4	Hasil Uji Autokorelasi	63
4.5	Hasil Uji Koefisien Determinasi	63
4.6	Hasil Uji Signifikansi Hipotesis Parsial	64
4.7	Hasil Uji Simultan (F)	75
4.8	Hasil Uji Robustness	76
4.9	Hasil Uji Signifikansi Hipotesis Periode Januari 2018- Februari 2020	79
4.10	Hasil Uji Signifikansi Hipotesis Periode Maret 2020- Desember 2022	81



*Mencerdaskan dan
Memartabatkan Bangsa*

DAFTAR LAMPIRAN

Lampiran	Judul	Halaman
1	Data Variabel Sampel Penelitian	100
2	Hasil Uji Statistik Deskriptif	102
3	Hasil Uji Normalitas	103
4	Hasil Uji Multikolinieritas	104
5	Hasil Uji Heterokedastisitas	105
6	Hasil Uji Autokorelasi	106
7	Hasil Regresi Linier Berganda	107
8	Hasil Robustness Test	108
9	Hasil Regresi Linier Berganda Periode Januari 2018- Februari 2020	109
10	Hasil Regresi Linier Berganda Periode Maret 2020- Desember 2022	110



*Mencerdaskan dan
Memartabatkan Bangsa*