

DAFTAR ISI

JUDUL	i
TITLE	ii
ABSTRAK	iii
ABSTRACT	iv
LEMBAR PENGESAHAN SKRIPSI	v
PERNYATAAN ORISINALITAS	vi
KATA PENGANTAR	vii
DAFTAR ISI	ix
DAFTAR TABEL	xii
DAFTAR GAMBAR	xii
DAFTAR LAMPIRAN	xiv
BAB I PENDAHULUAN	
A. Latar Belakang Masalah.....	1
B. Identifikasi Masalah.....	8
C. Pembatasan Masalah.....	8
D. Perumusan Masalah	8
E. Kegunaan Penelitian.....	9
BAB II KAJIAN TEORETIK	
A. Deskripsi Konseptual.....	10
1. IHSG (Indeks Harga Saham Gabungan).....	10
2. Inflasi.....	13
3. Kurs.....	19
B. Hasil Penelitian Yang Relevan.....	23
C. Kerangka Teoretik.....	27
1. Pengaruh Inflasi terhadap Pergerakan IHSG.....	27

2. Pengaruh Kurs terhadap Pergerakan IHSG.....	28
3. Pengaruh Pergerakan IHSG terhadap Kurs.....	29
D. Perumusan Hipotesis.....	31
BAB III METODOLOGI PENELITIAN	
A. Tujuan Penelitian.....	32
B. Obyek dan Ruang Lingkup Penelitian.....	32
C. Metode Penelitian.....	33
D. Jenis dan Sumber Data.....	38
E. Operasionalisasi Variabel Penelitian.....	39
1. IHSG (Indeks Harga Saham Gabungan).....	39
a. Definisi Konseptual.....	39
b. Definisi Operasional.....	39
2. Inflasi	39
a. Definisi Konseptual.....	39
b. Definisi Operasional.....	40
3. Kurs.....	40
a. Definisi Konseptual.....	40
b. Definisi Operasional.....	40
F. Teknik Analisis Data.....	40
1. Uji Stasioner.....	40
2. Uji Kointegrasi.....	42
3. Uji Lag.....	43
4. Uji Kausalitas Granger.....	44
BAB IV HASIL PENELITIAN DAN PEMBAHASAN	
A. Deskripsi Data.....	46
1. Indeks Harga Saham Gabungan (IHSG).....	46
2. Inflasi.....	49
3. Kurs.....	51

B. Analisis Data.....	52
1. Uji Stasioner.....	52
2. Uji Kointegrasi.....	54
a. Analisis Regresi Linear Berganda.....	54
b. Tes ADF pada residual Regresi.....	55
3. Uji Lag.....	56
4. Uji Kausalitas Grenger.....	57
5. Uji Vecm.....	58
C. Pembahasan.....	61
D. Keterbatasan Penelitian.....	65
BAB V KESIMPULAN, IMPLIKASI, DAN SARAN	
A. Kesimpulan.....	67
B. Implikasi.....	68
C. Saran.....	69
DAFTAR PUSTAKA.....	70
LAMPIRAN.....	73
RIWAYAT HIDUP.....	83

DAFTAR TABEL

Tabel I.1	Perkembangan IHSG dari Tahun 2004 – 2014.....	3
Tabel IV.4	Hasil Uji Stasioner.....	53
Tabel IV.5	Tes Analisis Regresi Linear Berganda.....	54
Tabel IV.6	Hasil Tes ADF Residu.....	55
Tabel IV.7	Penentuan Lag Optimal.....	56
Tabel IV.8	Hasil Uji Kausalitas Grenger.....	57
Tabel IV.9	Hasil Uji VECM.....	58

DAFTAR GAMBAR

Gambar I.1	Kurs Rupiah terhadap Dollar AS Tahun 2004 – 2015.....	4
Gambar I.2	Tingkat Inflasi Januari 2015 – November 2015.....	6
Gambar IV.1	Pergerakan Indeks Harga Saham Gabungan 2007 -2015.....	48
Gambar IV.2	Inflasi 2007 -2015.....	50
Gambar IV.3	Kurs 2011 -2015.....	51

DAFTAR LAMPIRAN

Lampiran 1	Data olahan penelitian (dalam Persen).....	73
Lampiran 2	Data Penelitian.....	75
Lampiran 3	Hasil Uji Stasioner.....	77
Lampiran 4	Uji ADF residu regresi.....	79
Lampiran 5	Hasil Uji VECM.....	80
Lampiran 6	Tabel t.....	82