

DAFTAR ISI

JUDUL PENELITIAN	i
TITTLE	ii
ABSTRAK	iii
ABSTRACT	iv
LEMBAR PENGESAHAN	v
PERNYATAAN ORISINALITAS	vi
LEMBAR PERSEMBAHAN	vii
KATA PENGANTAR	viii
DAFTAR ISI	xi
DAFTAR LAMPIRAN	xiv
DAFTAR TABEL	xv
DAFTAR GAMBAR	xvi
BAB I. PENDAHULUAN	
A. Latar Belakang Masalah.....	1
B. Identifikasi Masalah.....	21
C. Pembatasan Masalah	22
D. Perumusan Masalah	22
E. Kegunaan Penelitian	23
BAB II. KAJIAN TEORETIK	
A. Deskripsi Konseptual	24
1. Indeks Harga Saham Gabungan.....	24
2. Suku Bunga (SBI)	42
3. Inflasi	50
4. Nilai Tukar	58

B. Hasil Penelitian yang Relevan	62
C. Kerangka Teoretik.....	65
D. Perumusan Hipotesis.....	79

BAB III. METODOLOGI PENELITIAN

A. Tujuan Penelitian.....	80
B. Objek Penelitian	80
C. Metode Penelitian.....	81
D. Jenis dan Sumber Data	82
E. Operasionalisasi Variabel Penelitian.....	83
1. Indeks Harga Saham Gabungan	
a. Definisi Konseptual	83
b. Definisi Operasional	83
2. Suku Bunga (SBI)	
a. Definisi Konseptual	84
b. Definisi Operasional	84
3. Inflasi	
a. Definisi Konseptual	84
b. Definisi Operasional	85
3. Nilai Tukar	
a. Definisi Konseptual	86
b. Definisi Operasional	86
F. Konstelasi Pengaruh Antar Variabel	86
G. Teknik Analisis Data	86
1. Persamaan Regresi.....	87
2. Uji Hipotesis	
a. Uji t (partial test).....	88
b. Uji F(overall test)	89
3. Koefisien Determinasi	91
4. Uji Asumsi Klasik	
a. Uji Normalitas.....	92

b. Uji Heteroskedastistas	93
c. Uji Multikolinearitas.....	93
d. Uji Autokorelasi.....	94
 BAB IV. HASIL PENELITIAN DAN PEMBAHASAN	
A. Deskripsi Data	96
1. Indeks Harga Saham Gabungan	96
2. Suku Bunga SBI	99
3. Inflasi	101
4. Nilai Tukar Rupiah.....	103
B. Pengujian Hipotesis	105
1. Persamaan Regresi.....	105
2. Uji Hipotesis	
a. Uji t.....	106
b. Uji F.....	108
3. Analisis Koefisien Determinasi.....	109
4. Uji Asumsi Klasik	
a. Uji Normalitas	110
b. Uji Heteroskedastistas	111
c. Uji Multikolinearitas.....	113
d. Uji Autokorelasi.....	114
C. Pembahasan.....	114
D. Keterbatasan Penelitian.....	119
 BAB V. KESIMPULAN, IMPLIKASI DAN SARAN	
A. Kesimpulan	120
B. Implikasi.....	121
C. Saran.....	122
 DAFTAR PUSTAKA	124
LAMPIRAN	128
RIWAYAT HIDUP	137

DAFTAR LAMPIRAN

Lampiran	Judul	Halaman
1.	Data Indeks Harga Saham Gabungan, Nilai Suku Bunga SBI, Inflasi, Kurs Rupiah/US\$ Tahun 2005-2013	128
3.	Output SPSS 16.0	132
4.	Tabel Titik Distribusi F $\alpha = 0,05$	135
5.	Tabel Titik Distribusi t	136
6.	Tabel Durbin – Watson (DW), $\alpha = 5\%$	137
7.	Surat Permohonan Izin Penelitian Untuk Skripsi di Bank Indonesia	138
8.	Surat Permohonan Izin Penelitian Untuk Skripsi di Bursa Efek Indonesia	139
9.	Surat Permohonan Izin Penelitian Untuk Skripsi di Badan Pusat Statistik	140

DAFTAR TABEL

Tabel	Judul	Halaman
IV. 1	Data Indeks Harga Saham Gabungandi Bursa Efek Indonesia tahun 2005-2010.....	97
IV.2	Data Tingkat Sukui Bunga SBI Triwulan di Indonesia Periode tahun 2005-2010.....	99
IV.3	Data Tingkat Inflasi Triwulan di Indonesia Periode tahun 2005-2010	101
IV.4	Data Nilai Tukar Rupiah/US\$ Triwulan di Indonesia Periode tahun 2005-2010.....	104
IV. 5	PersamaanRegresi Linear Berganda.....	105
IV. 6	Uji Individual Parameter (<i>t-Test</i>).....	107
IV. 7	UjiKeseluruhan Parameter (<i>Overall F-Test</i>)	108
IV.8	Model Summary Tabel	109
IV. 9	Uji Normalitas Data	110
IV.10	Uji Multikolinearitas	113
IV.11	Uji Autokorelasi	114

DAFTAR GAMBAR

Gambar	Judul	Halaman
I.1	Kurva Pergerakan Indeks Harga Saham Gabungan Periode Triwulan pada Tahun 2005 - 2013	7
I.2	Kurva Demand Pull Inflation	9
I.3	Kurva Cost Push Inflation	9
I.4	Kurva Suku Bunga (SBI), Inflasi, dan Nilai Tukar Rupiah/US\$ Tahun 2005 – 2009	16
I.5	Kurva SukuBunga (SBI danInflasi Tahun 2005-2013	16
IV.1	Grafik Pergerakan Indeks Harga Saham Gabungan Triwulan Periode Tahun 2005– 2013	98
IV.2	Grafik Pergerakan Suku Bunga (SBI) Triwulan Periode Tahun 2005 – 2013	100
IV.3	Grafik Pergerakan Inflasi Triwulan Periode Tahun 2005 – 2013	102
IV.4	Grafik Pergerakan Nilai Kurs Rupiah/US\$Triwulan Periode	103
IV.5	Grafik <i>Scatterplot</i>	112