

## DAFTAR ISI

PERNYATAAN .....	II
MOTTO .....	III
HALAMAN PERSETUJUAN.....	IV
LEMBAR PENGESAHAN .....	V
DAFTAR RIWAYAT HIDUP.....	VI
PERSEMBAHAN.....	VII
ABSTRAK.....	IX
KATA PENGANTAR .....	X
DAFTAR ISI.....	XI
DAFTAR GAMBAR.....	XV
DAFTAR TABEL.....	XVI
BAB I PENDAHULUAN.....	1
1.1 Latar Belakang.....	1
1.2 Ruang Lingkup Penelitian.....	8
1.3 Rumusan Masalah.....	8
1.4 Tujuan Penelitian .....	9
1.5 Manfaat Penelitian .....	9
1.6 Sistematika Penulisan .....	9
BAB II LANDASAN TEORI.....	10
2.1 Signaling Theory (Teori Sinyal).....	10
2.2 Saham .....	11

2.3 Indeks Harga Saham .....	13
2.4 Indeks Harga Saham Gabungan.....	17
2.5 Faktor yang Mempengaruhi Indeks Harga Saham.....	18
2.6 Instrumen Makro Ekonomi.....	18
2.7 Penelitian Terdahulu .....	22
2.8 Kerangka Pemikiran .....	26
2.9 Bangunan Hipotesis .....	27
2.9.1 Pengaruh Inflasi Terhadap Indeks Harga Saham Gabungan .....	27
2.9.2 Pengaruh Suku Bunga Terhadap Indeks Harga Saham Gabungan.....	28
2.9.3 Pengaruh Nilai Tukar Rupiah (Rp) Terhadap Dollar Amerika (US\$) dan Indeks Harga Saham Gabungan .....	29
2.9.4 Pengaruh Jumlah Uang Beredar M2 (JUB) Terhadap Indeks Harga Saham Gabungan.....	30
<b>BAB III METODE PENELITIAN .....</b>	<b>31</b>
3.1 Sumber Data.....	31
3.2 Metode Pengumpulan Data.....	32
3.3 Populasi dan Sampel .....	33
3.3.1 Populasi .....	33
3.3.2 Sampel.....	33
3.4 Variabel Penelitian dan Definisi Operasional Variabel .....	34
3.4.1 Variabel Penelitian .....	34

3.4.2 Definisi Operasional Variabel .....	35
3.5 Metode Analisa Data.....	36
3.5.1 Statistik Deskriptif.....	36
3.5.2 Uji Asumsi Klasik .....	36
3.6 Pengujian Hipotesis.....	38
3.6.1 Analisis Regresi Linier Berganda.....	38
<b>BAB IV HASIL DAN PEMBAHASAN .....</b>	<b>40</b>
4.1 Data dan Sampel .....	40
4.2 Hasil Analisa Data.....	41
4.2.1 Analisis Statistik Deskriptif.....	41
4.2.2 Uji Asumsi Klasik .....	42
4.2.2.1 Hasil Uji Normalitas .....	42
4.2.2.2 Uji Normalitas.....	43
4.2.2.3 Uji Heteroskedastisitas.....	44
4.2.2.4 Uji Autokorelasi .....	45
4.3 Hasil Pengujian Hipotesis .....	45
4.3.1 Analisis Regresi Linier Berganda.....	45
4.3.2 Uji Koefisien Determinasi (R <sup>2</sup> ).....	47
4.3.3 Uji Statistik F.....	47
4.3.4 Uji Statistik T .....	48
4.4 Pembahasan.....	50
4.4.1 Pengaruh Inflasi Terhadap Indeks Harga Saham Gabungan .....	50

4.4.2 Pengaruh Suku Bunga Terhadap Indeks Harga Saham	
Gabungan .....	51
4.4.3 Pengaruh Nilai Tukar Rupiah Terhadap Indeks Harga Saham	
Gabungan.....	52
4.4.4 Pengaruh Jumlah Uang Beredar Terhadap Indeks Harga Saham	
Gabungan .....	53
BAB V SIMPULAN DAN SARAN.....	55
5.1 Simpulan .....	55
5.2 Saran.....	55
DAFTAR PUSTAKA .....	57

## **DAFTAR GAMBAR**

Gambar 1.1 Pergerakan IHSG .....	2
Gambar 1.2 Pergerakan Makro Ekonomi .....	4
Gambar 2.1 Kerangka Pemikiran.....	27

## DAFTAR TABEL

Tabel 2.1 Indeks Saham.....	16
Tabel 2.2 Penelitian Terdahulu.....	22
Tabel 3.1 Jenis dan Sumber Data.....	31
Tabel 4.1 Prosedur Pengambilan Sampel .....	40
Tabel 4.2 Statistik Deskriptif .....	41
Tabel 4.3 Uji Normalitas Kolmogorov Smirnov .....	42
Tabel 4.4 Uji Multikolonieritas <i>Tolerance</i> dan VIF .....	43
Tabel 4.5 Uji Heterodkedastisitas Glejser.....	44
Tabel 4.6 Uji Autokorelasi Durbin-Watson.....	45
Tabel 4.7 Analisis Regresi Linier Berganda .....	46
Tabel 4.8 Uji Koefisien Determinasi .....	47
Tabel 4.9 Uji Statistik F.....	48
Tabel 4.10 Uji Statistik T.....	49