

## DAFTAR ISI

<b>HALAMAN JUDUL</b>	
<b>PERNYATAAN DAN PERSETUJUAN TUGAS AKHIR .....</b>	<b>ii</b>
<b>PERSETUJUAN DOSEN PEMBIMBING TUGAS AKHIR .....</b>	<b>iii</b>
<b>PERSETUJUAN TIM PENGUJI TUGAS AKHIR .....</b>	<b>iv</b>
<b>ABSTRAK .....</b>	<b>v</b>
<b>ABSTRACT .....</b>	<b>vi</b>
<b>KATA PENGANTAR .....</b>	<b>vii</b>
<b>DAFTAR ISI.....</b>	<b>ix</b>
<b>DAFTAR GAMBAR .....</b>	<b>xii</b>
<b>DAFTAR TABEL.....</b>	<b>xiii</b>
<b>DAFTAR LAMPIRAN .....</b>	<b>xiv</b>
<b>BAB I PENDAHULUAN</b>	
1.1 Latar Belakang.....	1
1.2 Batasan Masalah.....	4
1.3 Rumusan Masalah.....	5
1.4 Tujuan Penelitian.....	6
1.5 Manfaat Penelitian.....	6
1.5.1 Manfaat Teoritis.....	6
1.5.2 Manfaat Praktis.....	8
1.6 Sistematika Penulisan.....	9
<b>BAB II TINJAUAN PUSTAKA DAN PENGEMBANGAN HIPOTESIS</b>	
2.1 Landasan Teori.....	11
2.1.1 Teori Signalling.....	11
2.1.2 Pasar Modal.....	12
2.1.3 Saham.....	13
2.1.4 Indeks LQ45.....	16
2.1.5 Jakarta Islamic Index (JII).....	17
2.1.6 Harga Saham.....	19
2.1.7 Suku bunga.....	22
2.1.8 Money Supply.....	25
2.1.9 Inflasi.....	27
2.1.9.1 Definisi Inflasi.....	27
2.1.9.2 Jenis-Jenis inflasi.....	28
2.1.9.3 Teori Inflasi.....	32
2.1.9.4 Metode Pengukuran Inflasi.....	33
2.1.10 Kurs Dolar.....	35
2.2 Penelitian Terdahulu.....	38
2.3 Pengembangan Hipotesis.....	39
2.3.1 Pengaruh Suku Bunga terhadap Indeks Saham.....	39
2.3.2 Pengaruh Jumlah Uang Beredar terhadap Indeks Saham.....	40
2.3.3 Pengaruh Inflasi terhadap Indeks Saham.....	40
2.3.4 Pengaruh Kurs Dolar terhadap Indeks Saham.....	41

2.4	Model Penelitian.....	41
2.5	Bagan Alur Berfikir.....	42

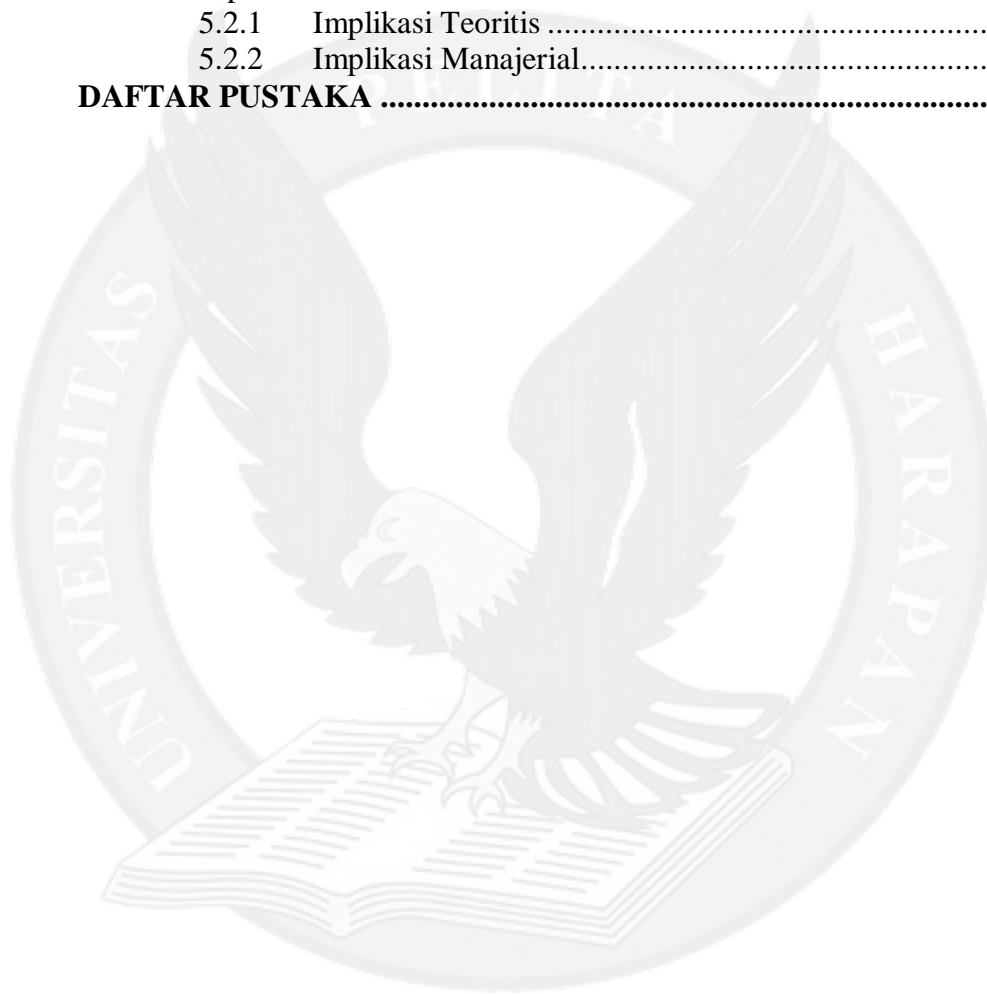
### **BAB III METODOLOGI PENELITIAN\**

3.1	Jenis Penelitian .....	43
3.2	Populasi dan Sampel.....	43
3.3	Metode Pengumpulan Data .....	44
3.4	Definisi Operasional dan Pengukuran Variable .....	45
3.4.1	Suku Bunga.....	45
3.4.2	Jumlah Uang Beredar .....	45
3.4.3	Inflasi.....	46
3.4.4	Kurs Dolar .....	46
3.4.5	Indeks Saham.....	46
3.5	Metode Menganalisis Data.....	47
3.5.1	Statistik Deskriptif.....	47
3.5.2	Uji Asumsi Klasik .....	48
3.5.2.1	Uji Normalitas .....	48
3.5.2.2	Uji Multikolinearitas .....	48
3.5.2.3	Uji Heteroskedastisitas .....	49
3.5.2.4	Uji Linearitas .....	49
3.5.2.5	Uji Autokorelasi.....	50
3.5.3	Analisis Linier Regresi Berganda (Multiple Regression) .	50
3.5.4	Uji Hipotesis .....	51
3.5.4.1	Uji T .....	51
3.5.4.2	Uji F .....	52
3.5.4.3	Koefisien Determinasi (R <sup>2</sup> ).....	52

### **BAB IV ANALISIS DATA DAN PEMBAHASAN**

4.1	Gambaran Umum .....	53
4.1.1	LQ45.....	53
4.1.2	Jakarta Islamic Index.....	54
4.1.3	Suku Bunga BI.....	56
4.1.4	Money Supply .....	57
4.1.5	Inflasi.....	58
4.1.6	Kurs Dolar .....	58
4.2	Analisis Data .....	59
4.2.1	Statistik Deskriptif.....	59
4.2.2	Analisis Asumsi Klasik .....	61
4.2.2.1	Uji Normalitas .....	61
4.2.2.2	Uji Multikolinearitas .....	64
4.2.2.3	Uji Heteroskedastisitas .....	65
4.2.2.4	Uji linearitas .....	67
4.2.2.5	Uji Autokorelasi.....	68
4.2.2.6	Analisis Linier Regresi Berganda (Multiple Regression) .....	70
4.2.3	Analisis Pengujian Hipotesis .....	73

	4.2.3.1 Uji-T.....	73
	4.2.3.2 Uji-F.....	76
	4.2.3.3 Uji Koefisien Determinasi (R <sup>2</sup> ).....	77
4.3	Pembahasan.....	79
<b>BAB V KESIMPULAN</b>		
5.1	Kesimpulan.....	88
	5.1.1 Simpulan atas Hipotesis.....	88
	5.1.2 Simpulan atas Masalah Penelitian.....	89
5.2	Implikasi.....	90
	5.2.1 Implikasi Teoritis .....	90
	5.2.2 Implikasi Manajerial.....	90
<b>DAFTAR PUSTAKA .....</b>		<b>93</b>



## DAFTAR GAMBAR

Gambar 2.1 Model Penelitian Terdahulu .....	38
Gambar 2.2 Model Penelitian .....	41
Gambar 2.3 Bagan Alur Berfikir .....	42
Gambar 4.1 Perubahan LQ45 .....	54
Gambar 4.2 Perubahan JII .....	55
Gambar 4.3 Perubahan Suku Bunga BI. ....	56
Gambar 4.4 Perubahan Money Supply .....	57
Gambar 4.5 Perubahan Inflasi .....	58
Gambar 4.6 Perubahan Kurs Dolar .....	59
Gambar 4.7 Hasil Plot P-P LQ45 .....	61
Gambar 4.8 Histogram LQ45 .....	62
Gambar 4.9 Hasil Plot P-P JII .....	62
Gambar 4.10 Histogram JII .....	62
Gambar 4.11 Hasil Scatterplot LQ45.....	65
Gambar 4.12 Hasil Scatterplot JII .....	66

## DAFTAR TABEL

Table 4.1 Statistik Deskriptif .....	60
Table 4.2 Hasil Uji Kolmogorov-Smirnov LQ45 .....	63
Table 4.3 Hasil Uji Kolmogorov-Smirnov JII .....	63
Table 4.4 Hasil Uji Multikolinearitas LQ45 .....	64
Table 4.5 Hasil Uji Multikolinearitas JII .....	64
Table 4.6 Hasil Uji Heteroskedastisitas LQ45 .....	66
Table 4.7 Hasil Uji Heteroskedastisitas JII .....	67
Table 4.8 Hasil Uji Linearitas LQ45 .....	68
Table 4.9 Hasil Uji Linearitas JII .....	68
Table 4.10 Hasil Uji Durbin-Watson LQ45 .....	69
Table 4.11 Hasil Uji Durbin-Watson JII .....	69
Table 4.12 Hasil Analisis Regresi LQ45 .....	70
Table 4.13 Hasil Analisis Regresi JII .....	70
Table 4.14 Hasil Uji Parsial (Uji T) LQ45 .....	73
Table 4.15 Hasil Uji Parsial (Uji T) JII .....	74
Table 4.16 Hasil Uji Simultan (Uji F) LQ45 .....	76
Table 4.17 Hasil Uji Simultan (Uji F) JII .....	76
Table 4.18 Hasil Uji Koefisien Determinasi ( $R^2$ ) LQ45 .....	78
Table 4.19 Hasil Uji Koefisien Determinasi ( $R^2$ ) JII .....	78

## DAFTAR LAMPIRAN

LAMPIRAN A: DATA SAMPLE PENELITIAN.....	A-1
LAMPIRAN B : HASIL OLAH DATA MENGGUNAKAN SPSS .....	B-1
LAMPIRAN C: TABEL STATISTIK .....	C-1

