

DAFTAR ISI

Halaman

LEMBAR PENGESAHAN	
SURAT PERNYATAAN KEASLIAN	
SURAT PUBLIKASI	
ABSTRACT	i
ABSTRAK	ii
KATA PENGANTAR	iii
DAFTAR ISI	vi
DAFTAR TABEL	ix
DAFTAR GAMBAR	x
DAFTAR LAMPIRAN	xi
BAB 1 PENDAHULUAN	1
1.1 Latar Belakang Penelitian	1
1.2 Identifikasi Masalah	6
1.3. Rumusan Masalah	6
1.4. Tujuan Penelitian	7
1.5. Kegunaan Penelitian.....	7
1.5.1 Kegunaan Praktis (Kegunaan Operasional).....	7
1.5.2 Kegunaan Akademis (Kegunaan Ilmu).....	8
BAB II KAJIAN PUSTAKA, KERANGKA PEMIKIRAN DAN HIPOTESIS	9
2.1 Kajian Pustaka.....	9
2.1.1 Pasar Modal.....	9
2.1.2 Inflasi	12
2.1.2.1 Indikator Inflasi	14
2.1.3 Suku Bunga	15
2.1.3.1 Indikator Suku Bunga.....	16
2.1.4 Harga Saham	17
2.1.4.1 Indikator Harga Saham.....	19
2.2 Kerangka Pemikiran.....	20
2.2.1 Inflasi (X1) Terhadap Harga Saham (Y).....	20
2.2.2 Suku Bunga (X2) Terhadap Harga Saham (Y)	21

2.3 Hipotesis	22
BAB III METODOLOGI PENELITIAN	23
3.1 Metode Penelitian	23
3.2 Operasionalisasi Variabel	23
3.3 Sumber Data dan Teknik Pengumpulan Data	24
3.4 Populasi, Sampel dan Tempat serta Waktu Penelitian.....	25
3.4.1 Populasi.....	25
3.4.2 Penarikan Sampel.....	27
3.4.3 Tempat dan Waktu Penelitian	30
3.4.3.1 Tempat Penelitian	30
3.4.3.2 Waktu Penelitian.....	30
3.5 Metode Analisis	31
3.5.1 Analisis Regresi Data Panel.....	31
3.5.2 Estimasi Model Regresi Data Panel	32
3.5.2.1 <i>Common Effect</i> Model (CEM)	32
3.5.2.2 <i>Random Effect</i> Model (REM)	33
3.5.2.3 <i>Fixed Effect</i> Model (FEM)	34
3.5.3 Uji Pemilihan Model Regresi Data Panel	35
3.5.3.1 Uji Chow	35
3.5.3.2 Uji Hausman.....	36
3.5.3.3 Uji Lagrange Multiplier (LM)	36
3.5.4 Analisis Statistik Deskriptif	37
3.5.5 Uji Asumsi Klasik.....	37
3.5.5.1 Uji Normalitas	38
3.5.5.2 Uji Multikolinearitas	38
3.5.5.3 Uji Heterokedastisitas	39
3.5.6 Uji Hipotesis.....	39
3.5.6.1 Uji T Hitung (Parsial).....	39
3.5.6.2 Uji Koefisien Korelasi.....	40
3.5.6.3 Uji Koefisien Determinasi.....	41
3.5.6.4 Penarikan Kesimpulan	42
BAB IV HASIL PENELITIAN DAN PEMBAHASAN.....	43
4.1 Hasil Penelitian	43
4.1.1 Hasil Analisis Deskriptif.....	43
4.1.1.1 Analisis Deskriptif Inflasi.....	43

4.1.1.2 Analisis Deskriptif Suku Bunga	47
4.1.1.3 Analisis Deskriptif Harga Saham	51
4.1.2 Hasil analisis Verifikatif.....	54
4.1.2.1 Pemilihan Model Estimasi Data Panel	54
4.1.2.1.1 <i>Common Effect</i> Model.....	55
4.1.2.1.2 <i>Fixed Effect</i> Model	55
4.1.2.1.3 <i>Random Effect</i> Model.....	56
4.1.2.2 Pemilihan Model Regresi Data Panel.....	57
4.1.2.3 Asumsi Klasik	61
4.1.2.4 Uji Regresi Data Panel.....	64
4.1.2.5 Uji Hipotesis.....	66
4.2 Pembahasan.....	71
4.2.1 Pengaruh Inflasi Terhadap Harga saham.....	71
4.2.2 Pengaruh Suku Bunga Terhadap Harga saham	71
BAB V KESIMPULAN DAN SARAN	75
5.1 Kesimpulan	75
5.2 Saran.....	76
DAFTAR PUSTAKA.....	78