DAFTAR ISI

Halaman

LEMBAR PENGESAHAN

PERNYATAAN KEASLIAN

MOTTO

ABTRACT i

ABSTRAK ii

KATA PENGANTAR iii

DAFTAR ISI vi

DAFTAR GAMBAR x

DAFTAR TABEL xii

DAFTAR LAMPIRAN xiv

BAB I PENDAHULUAN

1.1 Latar Belakang Penelitian 1

1.2 Identifikasi dan Rumusan Masalah 7

1.2.2 Identifikasi Masalah 7

1.2.3 Rumusan Masalah 7

1.3 Maksud dan Tujuan Penelitian 8

1.3.1 Maksud Penelitian 8

1.3.2 Tujuan Penelitian 8

1.4 Kegunaan Penelitian 9

1.4.1 Kegunaan Praktis 9

1.4.2 Kegunaan Akademis 10

1.5 Lokasi dan Waktu Penelitian 10

BAB II KAJIAN PUSTAKA, KERANGKA PEMIKIRAN DAN HIPOTESIS

2.1 Kajian Pustaka 11

2.1.1 Kurs Mata Uang Rupiah atas Dollar AS 11

2.1.1.1 Konsep Kurs Mata Uang Rupiah atas Dollar AS 11

2.1.1.2 Faktor-faktor Kurs Mata Uang Rupiah atas Dollar AS 12

2.1.1.3 Kebijakan Kurs Mata Uang Rupiah atas Dollar AS 14

2.1.2 Tingkat Suku Bunga SBI 15

2.1.2.1 Konsep Tingkat Suku Bunga 15

2.1.2.2 Faktor- Faktor dalam Suku Bunga 16

2.1.3 Tingkat Inflasi 17

2.1.3.1 Konsep Inflasi 17

2.1.3.2 Macam-Macam dalam Inflasi 18

2.1.3.3 Aspek- Aspek dalam Inflasi 18

2.1.4 Indeks Harga Saham Gabungan (IHSG) 19

2.1.4.1 Konsep Indeks Harga Saham Gabungan (IHSG) 19

2.1.4.2 Faktor- Faktor dalam IHSG 20

2.1.4.3 Metode Perhitungan IHSG 21

2.1.5 Penelitian Terdahulu 22

2.2 Kerangka Pemikiran 31

2.2.1 Hubungan Antara Kurs Mata Uang Rupiah atas Dollar AS pada IHSG 30

2.2.2 Hubungan Antara Tingkat Suku Bunga dengan Indeks Harga Saham Gabungan (IHSG) 32

2.2.3 Hubungan Antara Tingkat Inflasi dengan Indeks Harga Saham Gabungan (IHSG) 33
2.2.4 Hubungan Antara Kurs Mata Uang Rupiah atas Dollar AS, Tingkat Suku Bunga dan Tingkat Inflasi dengan IHSG 34
2.3 Hipotesis Penelitian 36

BAB III OBJEK DAN METODE PENELITIAN

3.1 Objek Penelitian 37
3.2 Metode Penelitian 38
3.2.1 Desain Penelitian 39
3.2.2 Operasional Variabel 41
3.2.3 Sumber Data dan Teknik Penentuan Data 44
3.2.3.1 Sumber Data 44
3.2.3.2 Teknik Penentuan Data 45
3.2.4 Teknik Pengumpulan Data 47
3.2.5 Rancangan Analisis Dan Uji Hipotesis 48
3.2.5.1 Rancangan Analisis 48
3.2.5.2 Uji Hipotesis 59

BAB IV HASIL DAN PEMBAHASAN

4.1 Gambaran Umum Perusahaan 67
4.1.1 Sejarah Perusahaan 67
4.1.1.1 Visi dan Misi PT. Bursa Efek Indonesia (BEI) 71
4.1.2 Struktur Organisasi PT. Bursa Efek Indonesia (BEI) 71

4.1.3 Aspek Kegiatan PT. Bursa Efek Indonesia (BEI) 72
4.2 Analisis Deskriptif 78
4.2.1 Perkembangan Kurs mata uang rupiah atas dollar AS 78
4.2.2 Perkembangan Tingkat Suku Bunga SBI 82
4.2.3 Perkembangan Tingkat Inflasi 85
4.2.4 Perkembangan Indeks Harga Saham Gabungan 88
4.3 Analisis Verifikatif 92
4.3.1 Uji Asumsi Klasik Regresi 92
4.3.2 Uji Regresi Linear Berganda 98
4.3.3 Uji Asumsi Klasik Regresi Linear Berganda Setelah Model Regresi Diperbaiki 99
4.3.4 Koefisien Korelasi dan Determinasi 105
4.3.5 Uji Hipotesis 106

BAB V SIMPULAN DAN SARAN

5.1 Simpulan 117
5.2 Saran 119

DAFTAR PUSTAKA 121
LAMPIRAN-LAMPIRAN 124

DAFTAR GAMBAR

Gambar 2.1 Paradigma Penelitian……..……..35

Gambar 3.1 Desain Penelitian……..……41

Gambar 3.2 Daerah Penerimaan dan Penolakan H_0 Secara Parsial……..64

Gambar 3.3 Daerah Penerimaan dan Penolakan H_0 Secara Parsial……..65

Gambar 3.4 Daerah Penerimaan dan Penolakan H_0 Secara Parsial……..65

Gambar 4.1 Struktur Organisasi PT. Bursa Efek Indonesia (BEI)…….. 72

Gambar 4.2 Perkembangan Kurs mata uang rupiah atas dollar AS
Periode Januari 2007 sampai dengan Desember 2011..... 81

Gambar 4.3 Perkembangan Kurs mata uang rupiah atas dollar AS
Per tahun 2007 - 2011 82

Gambar 4.4 Perkembangan Suku bunga Sertifikat Bank Indonesia (SBI)
Periode Januari 2007 sampai dengan Desember 2011..... 83

Gambar 4.5 Perkembangan Suku bunga Sertifikat Bank Indonesia (SBI)
Per tahun 2007 - 2011 85

Gambar 4.6 Tingkat inflasi Periode Januari 2007 - Desember 2011 86

Gambar 4.7 Tingkat inflasi Indonesia Pertahun 2007 – 2011 88

Gambar 4.8 Indeks Harga Saham Gabungan Pertahun 2007 – 2011 91

Gambar 4.9 Grafik Normal P-Plot (Asumsi Normalitas)..... 94

Gambar 4.10 Grafik Scatter Plot dari Hasil Pengujian
Heteroskedastisitas 96

Gambar 4.11 Diagram Daerah Pengujian Autokorelasi
dengan Uji Durbin Watson 97

Gambar 4.12 Grafik Normal P-Plot (Asumsi Normalitas) 101

Gambar 4.13 Grafik Scatter Plot dari Hasil Pengujian Heteroskedastisitas 104

Gambar 4.14 Diagram Daerah Pengujian Autokorelasi dengan
Uji Durbin Watson 105

Gambar 4.15 Daerah Penerimaan Dan Penolakan Ho Pada Pengujian Simultan 108

Gambar 4.16 Daerah Penerimaan dan Penolakan Uji Parsial X_1 terhadap Y 110

Gambar 4.17 Daerah Penerimaan dan Penolakan Uji Parsial X_2 terhadap Y 112

Gambar 4.18 Daerah Penerimaan dan Penolakan Uji Parsial X_3 terhadap Y 114

Gambar 4.19 Daerah Penerimaan dan Penolakan Uji Parsial X_4 terhadap Y 115

DAFTAR TABEL

Tabel 1.1 Perkembangan Kurs Mata Uang Rupiah atas Dollar AS, Tingkat Suku Bunga SBI, Tingkat Inflasi dan Indek Harga Saham Gabungan (IHSG) Periode 2007 sampai 2011 4
Tabel 1.2 Jadwal Kegiatan Penelitian 10
Tabel 2.1 Hasil Penelitian Terdahulu 32
Tabel 3.1 Operasionalisasi Variabel Penelitian 43
Tabel 3.2 Interpretasi Koefisien Korelasi 57
Tabel 3.3 Kategori Korelasi Metode Guilford 71
Tabel 4.1 Perkembangan Kurs mata uang rupiah atas dollar AS Periode Januari 2007 sampai dengan Desember 2011 78
Tabel 4.2 Perkembangan Suku bunga Sertifikat Bank Indonesia (SBI) Periode Januari 2007 sampai dengan Desember 2011 83
Tabel 4.3 Perkembangan Tingkat inflasi Periode Januari 2007 sampai dengan Desember 2011 86
Tabel 4.4 Perkembangan Indeks Harga Saham Gabungan Periode Januari 2007 sampai dengan Desember 2011 89
Tabel 4.5 Hasil Uji Normalitas Taksiran Model Regresi X –Y 93
Tabel 4.6 Hasil Uji Asumsi Multikolinearitas 94
Tabel 4.7 Uji Heteroskedastisitas 96
Tabel 4.8 Hasil Koefisien Regresi 98
Tabel 4.9 Hasil Uji Normalitas Taksiran Model Regresi X –Y 100
Tabel 4.10 Hasil Uji Asumsi Multikolinearitas 102

Tabel 4.11 Uji Heteroskedastisitas..... 103

Tabel 4.12 Tabel Hasil Perhitungan Koefisien Determinasi..... 105

Tabel 4.13 Hasil Uji Satatistik F..... 107

DAFTAR LAMPIRAN

Lampiran 1 Surat Penelitian kepada Perusahaan

Lampiran 2 Bukti Penelitian (Surat keterangan dari perusahaan)

Lampiran 3 Kartu Bimbingan Usulan Penelitian

Lampiran 4 Kartu Bimbingan Skripsi

Lampiran 5 Lembar Revisi Seminar Usulan Penelitian 1

Lampiran 6 Lembar Revisi Seminar Usulan Penelitian 2

Lampiran 7 Lembar Revisi Sidang 1

Lampiran 8 Lembar Revisi Sidang 2

Lampiran 9 Lembar Revisi Sidang 3

Lampiran 10 Daftar Riwayat Hidup

Lampiran 11 Perkembangan kurs mata uang rupiah atas dollar AS periode 2007-2011

Lampiran 12 Perkembangan tingkat suku bunga SBI periode 2007-2011

Lampiran 13 Perkembangan tingkat inflasi periode 2007-2011

Lampiran 14 Perkembangan Indeks Harga Saham Gabungan (IHSG) Periode 2007-2011