DAFTAR ISI

LEMBAR PENGESAHAN i

LEMBAR PERNYATAAN KEASLIAN..... ii

MOTTO iii

ABSTRAK iv

ABSTRACT v

KATAPENGANTAR vi

DAFTAR ISI viii

DAFTAR TABEL xiii

DAFTAR GAMBAR xiv

DAFTAR LAMPIRAN xv

BAB I PENDAHULULUAN..... 1

1.1 Latar Belakang Penelitian..... 1
1.2 Identifikasi dan Rumusan Masalah 7
1.2.1 Identifikasi Masalah 7
1.2.2 Rumusan Masalah 8
1.3 Maksud dan Tujuan Penelitian 9
1.3.1 Maksud Penelitian 9
1.3.2 Tujuan Penelitian 9
1.4 Kegunaan Penelitian..... 10
1.4.1 Kegunaan Akademis 10
1.4.2 Kegunaan Praktis 11
1.5 Lokasi dan Waktu Penelitian 10
1.5.1 Lokasi Penelitian 12
1.5.2 Waktu penelitian 13

BAB II KAJIAN PUSTAKA, KERANGKA PEMIKIRAN, HIPOTESIS 14

2.1 Kajian Pustaka 14

2.1.1 Pengertian Inflasi 14

2.1.1.1 Pengertian Inflasi 14

2.1.1.2 Jenis Inflasi 16
2.1.1.3 Penyebab Inflasi 18
2.1.1.4 Dampak Inflasi 19
2.1.1.5 Cara Pengukuran Inflasi 20
2.1.2 Tingkat Suku Bunga SBI 20
2.1.2.1 Pengertian Suku Bunga 20
2.1.2.2 Pengertian sertifikasi Bank Indonesia 22
2.1.2.3 Faktor yang Mempengaruhi Tingkat suku Bunga 22
2.1.3 Return Saham 24
2.1.3.1 Komponen Return Saham 26
2.1.3.2 Jenis-Jenis Saham 25
2.1.3.3 Harga Saham 27
2.1.3.4 Faktor yang Mempengaruhi Harga Saham..... 28
2.1.3.5 Pengertian Return Saham 30
2.1.4 Penelitian Terdahulu 32
2.2 Kerangka Pemikiran 35
2.2.1 Hubungan Tingkat Inflasi terhadap Tingkat SBI 36
2.2.2 Hubungan Inflasi Terhadap Return Saham 36
2.2.3 Hubungan Suku Bunga SBI Terhadap Return Saham 37
2.3.4 Hubungan Inflasi dan Suku Bunga Terhadap Retrn Saham37
2.2.3..... 37
2.3 Hipotesis 39

BAB III OBJEK DAN METODE PENELITIAN 40
3.1 Objek Penelitian 40
3.2 Metologi Penelitian 41
3.2.1 Desain Penelitian 42

3.2.2 Operasional Variabel 46
3.2.3 Sumber dan teknik Penentuan Data 48
3.2.3.1 Sumber Data 48
3.2.3.2 Teknik Penentuan Data 49
3.2.4 Teknik Pengumpulan Data 50
3.2.4.1 Studi Pustaka 51
3.2.5 Rancangan Analisis dan Pengujian Hipotesis 51
3.2.5.1 Rancangan Analisis 51
3.2.5.2 Pengujian Hipotesis 61

BAB IV HASIL PENELITIAN DAN PEMBAHASAN 66
4.1 Gambaran Umum Perusahaan 66
4.1.1 Sejarah Perusahaan 66
4.1.2 Struktur Organisasi Perusahaan 72
4.2 Pembahasan Penelitian 78
4.2.1 Analisis Deskriptif 78
4.2.1.1 Perkembangan Inflasi 78
4.2.1.2 Perkembangan Suku Bunga SBI 80
4.2.1.3 Perkembangan Return Saham 82
4.3 Analisis Verifikatif 86
4.3.1 Analisis Regresi Linier Berganda 86
4.3.1.1 Uji Asumsi Klasik 99
4.3.1.2 Analisis Koefisiensi Korelasi 104
4.3.1.3 Analisis Koefisiensi Determinasi 106
4.3.1.4 Hasil Pengujian Hipotesis 108

BAB V KESIMPILAN DAN SARAN 117

5.1 Kesimpulan 117

5.2 Saran 119

DAFTAR PUSTAKA 120

LAMPIRAN