

DAFTAR ISI

HALAMAN SAMPUL.....	i
HALAMAN JUDUL.....	ii
HALAMAN PERNYATAAN	iv
HALAMAN PERNYATAAN PERSETUJUAN AKADEMIS	v
KATA PENGANTAR	vi
DAFTAR ISI.....	x
DAFTAR TABEL.....	xiii
DAFTAR GAMBAR	xiv
BAB I PENDAHULUAN	1
1.1 Gambaran Umum Objek Penelitian	1
1.2 Latar Belakang Penelitian	2
1.3 Perumusan Masalah	8
1.4 Pertanyaan Penelitian	9
1.5 Tujuan Penelitian	9
1.6 Kegunaan Penelitian.....	10
1.6.1 Aspek Teoritis	10
1.6.2 Aspek Praktis	10
1.7 Ruang Lingkup Penelitian.....	11
1.7.1 Variabel Penelitian	11
1.7.2 Lokasi dan Objek Penelitian	11
1.7.3 Waktu dan Periode Penelitian	11
1.8 Sistematika Penulisan Tugas Akhir	11
BAB II TINJAUAN PUSTAKA.....	13
2.1 <i>Grand Theory</i>	13
2.1.1 Teori Sinyal (<i>Signalling Theory</i>)	13
2.1.2 Pasar Modal.....	14
2.1.3 Indeks Harga Saham	16
2.1.4 Indeks Harga Saham Gabungan	19
2.1.5 Inflasi	21
2.1.6 <i>BI Rate</i>	24
2.1.7 Nilai Tukar Rupiah.....	26
2.1.8 Dow Jones Industrial Average	27

2.1.9 Penelitian Terdahulu	28
2.2 Kerangka Pemikiran.....	39
2.2.1 Pengaruh Inflasi terhadap Indeks Harga Saham Gabungan.....	39
2.2.2 Pengaruh BI <i>Rate</i> terhadap Indeks Harga Saham Gabungan.....	39
2.2.3 Pengaruh Nilai Tukar Rupiah terhadap Indeks Harga Saham Gabungan....	40
2.2.4 Pengaruh <i>Dow Jones Industrial Average</i> Terhadap Indeks Harga Saham Gabungan.....	40
2.3 Hipotesis Penelitian.....	42
BAB III METODE PENELITIAN.....	43
3.1 Karakteristik Penelitian.....	43
3.2 Operasional Variabel.....	44
3.2.1 Variabel Dependen dan Variabel Terikat (Y).....	46
3.2.2 Variabel Independen atau Variabel Bebas (X).....	47
3.3 Tahapan Penelitian	48
3.4 Populasi dan Sampel	51
3.4.1 Populasi.....	51
3.4.2 Sampel.....	52
3.5 Pengumpulan Data dan Sumber Data	52
3.6 Teknis Analisis Data dan Pengujian Hipotesis	53
3.6.1 Teknis Analisis Data	53
3.6.1 Uji Asumsi Klasik.....	53
3.6.2 Uji Hipotesis	55
BAB IV HASIL PENELITIAN DAN PEMBAHASAN.....	59
4.1 Hasil Penelitian.....	59
4.1.1 Analisis Statistik Deskriptif	59
4.1.2 Uji Asumsi Klasik.....	63
4.1.2.1 Uji Normalitas.....	63
4.1.2.2 Pengujian Autokorelasi	64
4.1.2.3 Pengujian Multikolinearitas	65
4.1.2.4 Pengujian Heteroskedastisitas.....	66
4.1.3 Analisis Linear Berganda.....	67
4.1.3.1 Pengujian Koefisien Determinasi.....	68
4.1.3.2 Uji Signifikansi Simultan (Uji Statistik F).....	69

4.1.3.3 Uji Signifikansi Parsial (Uji Statistik t)	70
4.2 Pembahasan Hasil Penelitian	73
4.2.1 Pengaruh Inflasi terhadap IHSG	73
4.2.2 Pengaruh BI <i>Rate</i> terhadap IHSG	74
4.2.3 Pengaruh Nilai Tukar Rupiah terhadap IHSG	75
4.2.4 Pengaruh <i>DJIA</i> terhadap IHSG	75
BAB V KESIMPULAN DAN SARAN.....	77
5.1. Kesimpulan	77
5.2. Saran.....	78
5.2.1. Aspek Teoritis	78
5.2.2. Aspek Praktis	78
DAFTAR PUSTAKA	80
LAMPIRAN.....	83