

DAFTAR ISI

LEMBAR PENGESAHAN	i
PERNYATAAN	ii
ABSTRAK	iii
KATA PENGANTAR	iv
DAFTAR ISI	vi
DAFTAR TABEL	x
DAFTAR GAMBAR	xii
DAFTAR GRAFIK	xiii
BAB I PENDAHULUAN	1
1.1. Latar Belakang Penelitian	1
1.2. Identifikasi Masalah	5
1.3. Pembatasan Masalah	6
1.4. Perumusan Masalah	7
1.5. Maksud dan Tujuan Penelitian	7
1.6. Kegunaan Penelitian	8
1.6.1. Kegunaan Teoritis	8
1.6.2. Kegunaan Praktis	9
1.7. Lokasi dan Waktu Penelitian	10
1.7.1. Lokasi Penelitian.....	10
1.7.2. Lokasi Penelitian.....	11
BAB II TINJAUAN PUSTAKA	12
2.1. Teori dan Konsep	12
2.1.1. Pasar Modal.....	12
2.1.1.1 Definisi Pasar Modal	12
2.1.1.2 Jenis-jenis atau Kategori Pasar Modal.....	13
2.1.1.3 Fungsi Pasar Modal	14
2.1.1.4 Karakteristik Pasar Modal	15
2.1.1.5 Instrumen Pasar Modal	15
2.1.2. Saham.....	16

2.1.2.1	Pengertian Saham	16
2.1.2.2	Jenis-jenis Saham	17
2.1.2.3	Keuntungan Saham.....	18
2.1.3.	Harga Saham	18
2.1.3.1	Pengertian Harga Saham.....	18
2.1.3.2	Jenis-jenis Harga Saham.....	19
2.1.3.3	Faktor-faktor yang Mempengaruhi Harga Saham	21
2.1.4.	Indeks Harga Saham	22
2.1.4.1	Definisi Indeks Harga Saham	22
2.1.4.2	Jenis-jenis Indeks Harga Saham	23
2.1.4.3	Indeks Sektor Pertambangan	24
2.1.4.4	Indeks LQ45	24
2.1.5.	Harga Minyak Dunia.....	25
2.1.5.1	Definisi dan Perkembangan Harga Minyak Dunia	25
2.1.5.2	Mekanisme Transmisi Harga Minyak	27
2.1.6.	Tingkat Suku Bunga.....	28
2.1.6.1	Pengertian Tingkat Suku Bunga	28
2.1.6.2	Jenis-jenis Tingkat Suku Bunga	28
2.1.6.3	Fungsi Tingkat Suku Bunga	29
2.1.6.4	Faktor yang Mempengaruhi Tingkat Suku Bunga	29
2.1.6.5	Pengukuran Tingkat Suku Bunga	31
2.1.7.	Inflasi	31
2.1.7.1	Pengertian Inflasi	31
2.1.7.2	Jenis-jenis Inflasi	32
2.1.7.3	Penggolongan Inflasi	33
2.1.7.4	Faktor yang Mempengaruhi Inflasi	34
2.1.7.5	Pengukuran Inflasi	35
2.1.8.	Nilai Tukar	36
2.1.8.1	Pengertian Nilai Tukar.....	36
2.1.8.2	Sistem Nilai Tukar Mata Uang	37
2.1.8.3	Jenis-jenis Nilai Tukar	38

2.1.8.4	Faktor yang Mempengaruhi Nilai Tukar	39
2.1.8.5	Pengukuran Nilai Tukar.....	41
2.2.	Kajian Empiris	42
2.3.	Kerangka Pemikiran dan Hipotesis	43
2.3.1.	Landasan Teoritis	43
2.3.2.	Paradigma Pemikiran	47
2.3.3.	Hipotesis.....	48
BAB III	METODE PENELITIAN	49
3.1.	Desain Penelitian	49
3.2.	Jenis dan Sumber Data Penelitian	51
3.2.1	Jenis Data	51
3.2.2	Sumber Data.....	51
3.3.	Populasi dan Sampel.....	52
3.3.1	Populasi	52
3.3.2	Sampel.....	55
3.4.	Definisi dan Operasionalisasi Variabel	58
3.5.	Teknik Analisis Data dan Pengujian Hipotesis	61
3.5.1	Analisis Deskriptif	61
3.5.2	Analisis Regresi Data Panel	61
3.5.2.1.	Pemilihan Model Regresi Data Panel.....	64
3.5.3	Uji Asumsi Klasik.....	66
3.5.4	Pengujian Hipotesis.....	68
3.5.4.1.	Pengujian Hipotesis Parsial (Uji t)	69
3.5.4.2.	Pengujian Hipotesis Simultan (Uji F)	70
3.5.5	Koefisien Determinasi.....	71
BAB IV	HASIL PENELITIAN DAN PEMBAHASAN	72
4.1.	Hasil Penelitian.....	72
4.1.1	Deskripsi Data.....	72
4.1.2	Analisis Deskriptif	73
4.1.2.1.	Harga Minyak Dunia.....	73
4.1.2.2.	Suku Bunga	76

4.1.2.3. Inflasi.....	78
4.1.2.4. Nilai Tukar	81
4.1.2.5. Harga Saham	84
4.1.3 Analisis Statistik	87
4.1.3.1. Estimasi Regresi Data Panel	87
4.1.3.2. Pemilihan Model Terbaik.....	90
4.1.3.3. Uji Asumsi Klasik	93
4.1.3.4. Koefisien Determinasi.....	97
4.2. Pengujian Hipotesis	98
4.3. Pembahasan Hasil Penelitian.....	100
4.3.1 Pengaruh Secara Parsial	100
4.3.2 Pengaruh Secara Simultan.....	103
BAB V KESIMPULAN DAN SARAN	104
5.1. Kesimpulan.....	104
5.2. Saran	106
DAFTAR PUSTAKA	
LAMPIRAN	

DAFTAR TABEL

1.1. Waktu Penelitian	11
2.1. Kajian Penelitian Terdahulu	42
3.1. Desain Penelitian	51
3.2. Emiten Tambang Indeks Papan Utama & Pengembangan.....	53
3.3. Emiten Pertambangan Indeks LQ45.....	57
3.4. Emiten Pertambangan Indeks LQ45.....	58
3.5. Operasionalisasi Variabel	60
3.6. Tabel Uji Durbin-Watson (DW Test).....	68
4.1. Emiten Tambang LQ45	72
4.2. Data Harga Minyak Dunia.....	74
4.3. Data Suku Bunga.....	76
4.4. Data Inflasi	79
4.5. Data Nilai Tukar	82
4.6. Data Perusahaan Pertambangan.....	84
4.7. Data Perusahaan Pertambangan.....	85
4.8. Common Effect Model	87
4.9. Fixed Effect Model.....	88
4.10. Random Effect Model	89
4.11. Uji Chow	90
4.12. Uji Hausman.....	91
4.13. Uji Lagrange Multiplier.....	92
4.14. Uji Multikolinieritas	94

4.15. Uji Heteroskedastisitas	95
4.16. Uji Non Autokorelasi	96
4.17. Koefisien Determinasi	97
4.18. Uji t.....	98
4.19. Uji f.....	100

DAFTAR GAMBAR

2.1. Paradigma Pemikiran.....	47
4.1. Uji Normalitas	93

DAFTAR GRAFIK

1.1. Indeks Harga Saham Sektor Pertambangan.....	1
1.2. Perkembangan Harga Minyak Dunia, Inflasi, Suku Bunga, Nilai Tukar dan Indeks LQ45	3
4.1. Grafik Harga Minyak Dunia.....	75
4.2. Grafik Suku Bunga	78
4.3. Grafik Inflasi	80
4.4. Grafik Nilai Tukar	83