

DAFTAR ISI

BAB 1 PENDAHULUAN

1.1	Latar Belakang Penelitian	1
1.2	Identifikasi Masalah.....	5
1.3	Rumusan Masalah.....	5
1.4	Maksud dan Tujuan Penelitian.....	6
1.4.1	Maksud Penelitian.....	6
1.4.2	Tujuan Penelitian	6
1.5	Kegunaan Penelitian	7
1.5.1	Kegunaan Teoritis	6
1.5.2	Kegunaan Praktis	6
1.6	Kerangka Pemikiran dan Hipotesis.....	8
1.6.1	Landasan Teori.....	8
1.6.2	Studi Empiris.....	12
1.6.3	Hipotesis.....	13
1.7	Lokasi dan Waktu Penelitian	14

BAB II TINJAUAN PUSTAKA

2.1	Pasar Modal	15
2.1.1	Pengertian Pasar Modal	15
2.1.2	Fungsi Pasar Modal	16
2.1.3	Jenis Pasar Modal	17
2.1.4	Instrumen Pasar Modal.....	19
2.1.5	Pihak-pihak yang Terkait dengan Pasar Modal.....	20
2.1.6	Faktor yang Mempengaruhi Pasar Modal	24
2.2	Investasi	25
2.2.1	Pengertian Investasi	25
2.2.2	Tujuan dan Manfaat Investasi	25
2.2.3	Dasar Keputusan Investasi	26
2.2.4	Jenis-jenis Investasi.....	27
2.2.5	Proses Investasi	28

2.3 Saham.....	30
2.3.1 Definisi Saham	30
2.3.2 KeuntunganMemiliki Saham	30
2.3.3 Analisis Saham.....	31
2.4 Indeks Harga Saham	32
2.4.1 Pengertian Indeks Harga Saham	32
2.4.2 Jenis-jenis Indeks	33
2.5 Indeks LQ45.....	34
2.5.1 Pengertian dan Kriteria Pemilihan Indeks LQ45	34
2.5.2 Evaluasi dan Penggantian Saham Indeks LQ45.....	35
2.5.3 Faktor-faktor yang Mempengaruhi Indeks Harga Saham.....	36
2.6 Nilai Transaksi	38
2.6.1 Nilai Saham.....	38
2.6.2 Pengertian Nilai Transaksi Saham	39
2.7 Volume Perdagangan	40
2.7.1 Pengertian Volume Perdagangan	40
2.7.2 Faktor-faktor yang Mempengaruhi Volume Perdagangan.....	41
2.7.3 Perhitungan Volume Perdagangan.....	43
2.8 Nilai Tukar Rupiah	44
2.8.1 Pengertian Nilai Tukar	44
2.8.2 Jenis Nilai Tukar	45
2.8.3 Tujuan Peramalan Pergerakan Nilai Tukar	46
2.8.4 Faktor-faktor yang Mempengaruhi Nilai Tukar.....	46
2.8.5 Perhitungan Transaksi Nilai Tukar	47

BAB III METODE PENELITIAN

3.1 Objek Penelitian	48
3.2 Metode Penelitian	48
3.3 Jenis dan Sumber Data	49
3.3.1 Jenis Data	49
3.3.2 Sumber Data.....	50
3.3.3 Teknik Pengumpulan Data.....	51
3.4 Populasi dan Sampel	51

3.4.1 Populasi	51
3.4.2 Sampel.....	52
3.5 Definisi dan Operasionalisasi Variabel.....	53
3.6 Teknik Analisis Data dan Pengujian Hipotesis	55
3.6.1 Analisis Deskriptif	55
3.6.2 Analisis Data Statistik	56
3.6.2.1 Pengujian Asumsi Klasik	56
3.6.2.2 Analisis Korelasi	58
3.6.2.3 Analisis Regresi Linier Berganda	60
3.6.2.4 Analisis Koefisien Determinasi.....	61
3.6.3 Rancangan Uji Hipotesis.....	61

BAB IV HASIL PENELITIAN DAN PEMBAHASAN

4.1 Hasil Penelitian.....	65
4.1.1 Deskripsi Penelitian.....	65
4.1.2 Analisis Deskriptif.....	65
4.1.2.1 Perkembangan Nilai Transaksi.....	65
4.1.2.2 Perkembangan Volume Perdagangan.....	69
4.1.2.3 Perkembangan Nilai Tukar Rupiah	72
4.1.2.4 Perkembangan Indeks LQ45	74
4.1.3 Analisis Statistik.....	76
4.1.3.1 Uji Asumsi Klasik	77
4.1.3.2 Analisis Korelasi	82
4.1.3.3 Analisis Regresi Linier Berganda	84
4.1.3.4 Analisis Koefisien Determinasi.....	84
4.1.4 Pengujian Hipotesis.....	86
4.2 Pembahasan	88
4.2.1 Pengaruh Nilai Transaksi Terhadap Indeks LQ45	88
4.2.2 Pengaruh Volume Perdagangan Terhadap Indeks LQ45	90
4.2.3 Pengaruh Nilai Tukar Rupiah Terhadap Indeks LQ45.....	91
4.2.4 Pengaruh Nilai Transaksi, Volume Perdagangan dan Nilai Tukar Rupiah Terhadap Indeks LQ45.....	92

BAB V KESIMPULAN DAN SARAN

5.1 Kesimpulan.....94

5.2 Saran.....95

DAFTAR PUSTAKA96

DAFTAR GAMBAR

1.1	Grafik Pergerakan Indeks LQ45 dan Inflasi	2
1.2	Kerangka Penelitian	11
4.1	Grafik Perkembangan Nilai Transaksi	66
4.2	Grafik Perkembangan Volume Perdagangan	69
4.3	Grafik Perkembangan Nilai Tukar Rupiah	72
4.4	Grafik Perkembangan Indeks LQ45	74
4.5	Hasil Uji Normalitas	78
4.6	Hasil Uji Heteroskedastisitas	80

DAFTAR TABEL

1.1	Penelitian Terdahulu.....	12
3.1	Operasionalisasi Variabel	54
3.2	Pedoman Interpretasi Koefisien Determinasi.....	59
4.1	Tabel Perkembangan Nilai Transaksi.....	66
4.2	Tabel Perkembangan Volume Perdagangan.....	69
4.3	Tabel Perkembangan Nilai Tukar Rupiah.....	72
4.4	Tabel Perkembangan Indeks LQ45.....	74
4.5	Hasil Uji Normalitas.....	77
4.6	Hasil Uji Multikolinieritas.....	79
4.7	Hasil Uji Auto Korelasi.....	81
4.8	Analisis Korelasi.....	82
4.9	Analisis Regresi Linier Berganda.....	83
4.10	Analisis Koefisien Determinasi Simultan.....	85
4.11	Analisis Koefisien Determinasi Parsial.....	85