

DAFTAR ISI

HALAMAN JUDUL.....	i
LEMBAR PENGESAHAN	ii
PERNYATAAN KEASLIAN.....	iv
MOTTO	v
PERSEMBAHAN	vi
INTISARI.....	ix
<i>ABSTRACT</i>	x
DAFTAR TABEL.....	xiv
DAFTAR GRAFIK.....	xv
DAFTAR LAMPIRAN.....	xvi
BAB I PENDAHULUAN	1
1.1. Latar Belakang	1
1.2. Rumusan Masalah	5
1.3. Tujuan Penelitian.....	5
1.4. Manfaat Penelitian.....	6
1.5. Keaslian Penelitian	6
BAB II TINJAUAN PUSTAKA.....	11
2.1. Landasan Teori	11
2.1.1. Indeks Harga Saham Perbankan	11
2.1.2. Nilai Tukar	15
2.1.3. Pengaruh Nilai Tukar terhadap Indeks Harga Saham Perbankan....	17
2.1.4. Suku Bunga.....	18
2.1.5. Pengaruh Suku Bunga terhadap Indeks Harga Saham Perbankan...	21
2.1.6. Harga Minyak Dunia	23

2.1.7. Pengaruh Harga Minyak Dunia terhadap Indeks Harga Saham Perbankan.....	24
2.1.8. Harga Emas Dunia	25
2.1.9. Pengaruh Harga Emas Dunia terhadap Indeks Harga Saham Perbankan.....	26
2.1.10. Hasil Penelitian Terlebih Dahulu.....	27
BAB III METODE PENELITIAN.....	33
3.1. Jenis Penelitian	33
3.2. Jenis dan Sumber Data	33
3.3. Definisi Operasional Variabel	34
3.4. Alat Analisis	35
3.4.1. Uji Perilaku Data	37
3.4.2. Uji Tahap Pertama	39
3.4.3. Uji Asumsi Klasik.....	39
BAB IV PEMBAHASAN.....	42
4.1. Deskripsi Data	42
4.2. Perkembangan Indeks Harga Saham Perbankan	42
4.2.1 Perkembangan Nilai Tukar Dollar terhadap Rupiah.....	43
4.2.2 Perkembangan Suku Bunga.....	45
4.2.3 Perkembangan Harga Minyak Dunia.....	45
4.2.4 Perkembangan Harga Emas Dunia	46
4.3. Uji Perilaku Data	47
4.3.1. Uji Stasioneritas (Unit Root Test)	48
4.3.2. Derajat Kointegrasi	48
4.4. Uji Perilaku Data	49
4.5. Regresi Jangka Pendek (ECM).....	51

4.7. Uji Tahap Pertama	53
4.6.1. Uji Signifikansi Parameter Individual (Uji T)	53
4.6.2. Uji Signifikansi Simultan (Uji F).....	57
4.6.3. Uji Koefisien Determinasi (R ²).....	57
4.8. Uji Asumsi Klasik	57
4.7.1. Uji Autokorelasi.....	58
4.7.2. Uji Heteroskedastisitas	58
4.7.3. Uji Multikolinieritas	58
4.7.4. Uji Normalitas.....	59
4.7.5. Uji Linieritas	59
4.9. Hasil dan Pembahasan	60
BAB V KESIMPULAN DAN SARAN.....	68
5.1 Kesimpulan.....	68
5.2 Saran	69
DAFTAR PUSTAKA	70
LAMPIRAN.....	75

DAFTAR TABEL

Tabel 1.1 Pergerakan Indeks harga saham perbankan, Nilai tukar, Suku Bunga, Harga minyak dunia, Harga emas dunia Tahun 2009-2019	3
Tabel 1.2 Penelitian Terdahulu.....	6
Tabel 4.1 Hasil Uji Stasioneritas.....	48
Tabel 4.2 Hasil Uji Stasioneritas Pada Residual Persamaan Regresi	49
Tabel 4.3 Hasil Estimasi OLS (Jangka Panjang)	49
Tabel 4.4 Hasil Estimasi ECM(Jangka Pendek)	51
Tabel 4.5 Hasil Uji t-Statistik Jangka Panjang	53
Tabel 4.6 Hasil Uji t-Statistik Jangka Pendek (ECM).....	55
Tabel 4.7 Uji Autokorelasi Breusch-Godfrey LM-Test	58
Tabel 4.8 Uji Heteroskedastisitas : Breusch-Pagan-Godfrey.....	58
Tabel 4.9 Uji Multikolinieritas.....	59

DAFTAR GRAFIK

Grafik 2.1 Kurva Marginal Efficiency Investment (MEI).....	21
Grafik 2.2 Hubungan Tingkat Bunga dan Investasi.....	22
Grafik 4.1 Perkembangan Indeks harga saham perbankan 2009.1-2019.4 ..	43
Grafik 4.2 Perkembangan USD/IDR 2009.1-2019.4	44
Grafik 4.3 Perkembangan Suku Bunga 2009.1-2019.4.....	45
Grafik 4.4 Perkembangan Harga Minyak Dunia 2009.1-2019.4	46
Grafik 4.5 Perkembangan Harga Emas Dunia 2009.1-2019.4.....	47

DAFTAR LAMPIRAN

Lampiran 1 Data Penelitian	76
Lampiran 2 Uji Stasioneritas Derajat Level (Indeks harga saham perbankan)	78
Lampiran 3 Uji Stasioneritas Derajat Level (Nilai Tukar)	79
Lampiran 4 Uji Stasioneritas Derajat Level (Suku Bunga)	80
Lampiran 5 Uji Stasioneritas Derajat Level (Harga Minyak Dunia)	81
Lampiran 6 Uji Stasioneritas Derajat Level (Harga Emas Dunia)	82
Lampiran 7 Uji Stasioneritas 1 st Difference (Indeks harga saham perbankan)	83
Lampiran 8 Uji Stasioneritas 1 st Difference (Nilai Tukar)	84
Lampiran 9 Uji Stasioneritas 1 st Difference (Suku Bunga)	85
Lampiran 10 Uji Stasioneritas 1 st Difference (Harga Minyak Dunia)	86
Lampiran 11 Uji Stasioneritas 1 st Difference (Harga Emas Dunia)	87
Lampiran 12 Uji Jangka Panjang	88
Lampiran 13 Uji Kointegrasi	89
Lampiran 14 Uji Jangka Pendek	90
Lampiran 15 Uji Multikolinearitas	91
Lampiran 16 Uji Autokorelasi	91
Lampiran 17 Uji Heteroskedastisitas	92
Lampiran 18 Uji Normalitas	92
Lampiran 19 Uji Linieritas	93