

## DAFTAR ISI

	<b>Halaman</b>
JUDUL .....	i
HALAMAN PERSETUJUAN SKRIPSI.....	ii
PERNYATAAN ORISINALITAS SKRIPSI.....	iii
MOTTO DAN PERSEMBAHAN .....	iv
<i>ABSTRACT</i> .....	v
ABSTRAK .....	vi
KATA PENGANTAR.....	viii
DAFTAR TABEL.....	ix
DAFTAR GAMBAR.....	x
DAFTAR LAMPIRAN.....	xi
BAB I      PENDAHULUAN.....	1
1.1    Latar belakang .....	1
1.2    Rumusan Masalah .....	9
1.3    Tujuan dan Kegunaan.....	10
1.3.1    Tujuan Penelitian.....	10
1.3.2    Kegunaan penelitian.....	10
1.4    Sistematika Penulisan.....	11
BAB II     TINJAUAN PUSTAKA .....	13
2.1    Landasan teori .....	13
2.1.1    Teori Investasi.....	13
2.1.2    Teori Portofolio.....	13
2.1.3    Nilai Tukar (Kurs).....	16
2.1.4    Tingkat Suku Bunga .....	22
2.1.5    Sertifikat Bank Indonesia .....	24
2.1.6    Inflasi .....	25
2.1.7    Jumlah Uang Beredar (M2) .....	26
2.1.8    Indeks Harga Saham .....	27
2.2    Penelitian Terdahulu.....	30
2.3    Kerangka Pemikiran.....	33
2.4    Hipotesis .....	37

BAB III	METODE PENELITIAN .....	39
3.1	Variabel Penelitian dan Definisi Operasional .....	39
3.1.1	Variabel Penelitian.....	39
3.1.2	Definisi Operasional Variabel.....	39
3.2	Jenis dan Sumber Data .....	41
3.3	Metode Pengumpulan Data .....	41
3.4	Analisis Data .....	42
3.5	Metode Analisis.....	42
3.6	Uji Asumsi Klasik .....	44
3.5.1.	Uji Normalitas .....	45
3.5.2.	Uji Autokorelasi .....	45
3.5.3.	Uji Heteroskedastisitas .....	46
3.5.4.	Uji Multikolinieritas .....	47
3.7	Pengujian Statistik Analisis Berganda.....	48
3.6.1.	Koefisien Determinasi ( $R^2$ ) .....	49
3.6.2.	Pengujian Best of Fit Model .....	50
BAB IV	HASIL DAN PEMBAHASAN .....	52
4.1	Gambaran Umum Objek Penelitian .....	52
4.1.1	Bursa Efek Indonesia (BEI) .....	52
4.2	Deskripsi Variabel Penelitian .....	55
4.2.1	Statistik Deskriptif .....	55
4.2.2	Perkembangan IHSG Januari 1999 - Juni 2010.....	56
4.2.3	Nilai Tukar (Kurs) Rupiah Terhadap Dolar Amerika Januari 1999 - Juni 2010 .....	60
4.2.4	Perkembangan Tingkat Suku Bunga SBI Januari 1999 – Juni 2010.....	61
4.2.5	Perkembangan Inflasi Januari 1999 - Juni 2010.....	63
4.2.6	Perkembangan Jumlah Uang Beredar (M2) Januari 1999 - Juni 2010.....	65
4.3	Analisis Data dan Pembahasan .....	67
4.3.1	Uji Penyimpangan Terhadap Asumsi Klasik .....	67
4.3.1.1	Uji Multikolinieritas.....	67
4.3.1.2	Uji Autokorelasi.....	68
4.3.1.3	Uji Heteroskedastisitas.....	69
4.3.1.4	Uji Normalitas.....	70
4.3.2	Koefisien determinasi ( $R^2$ ) .....	71
4.3.3	Pengujian <i>Best of Fit Model</i> .....	72
4.3.3.1	Pengujian Signifikansi Simultan (Uji F).....	72
4.3.3.2	Pengujian Signifikansi Parameter Individual (Uji t).....	73
4.3.4	Interpretasi dan Pembahasan .....	74

BAB V	PENUTUP .....	79
5.1	Kesimpulan .....	79
5.2	Saran .....	80
	DAFTAR PUSTAKA .....	81
	LAMPIRAN .....	84

