

DAFTAR ISI

HALAMAN JUDUL	ii
PERSETUJUAN SKRIPSI	ii
PENGESAHAN KELULUSAN UJIAN	iii
PERNYATAAN ORISINALITAS SKRIPSI	iv
MOTTO DAN PERSEMBAHAN	v
ABSTRACT	vi
ABSTRAK	vii
KATA PENGANTAR	viii
DAFTAR TABEL	xiii
DAFTAR GAMBAR	xiv
DAFTAR LAMPIRAN	xv
BAB I PENDAHULUAN	1
1.1. Latar Belakang Masalah	1
1.2. Rumusan Masalah	15
1.3. Tujuan Penelitian	16
1.4. Kegunaan Penelitian	17
1.5. Sistematika Penulisan	18
BAB II TINJAUAN PUSTAKA	21
2.1. Definisi dan Landasan Teori	21
2.1.1. Investasi	21
2.1.2. Pasar Modal	23
2.1.3. Teori Pasar Efisien	27
2.1.4. Return Saham	31
2.1.5. Foreign Inflow	32
2.1.6. Inflasi	33
2.1.7. Suku bunga	35
2.1.8. Nilai Tukar	37
2.2. Penelitian Terdahulu	40
2.3. Pengaruh Antar Variabel	44
2.4. Kerangka Pemikiran	49
2.5. Hipotesis	49

BAB III METODE PENELITIAN	51
3.1. Variabel Penelitian dan Definisi Operasional Variabel.....	51
3.1.1. Variabel Penelitian	51
3.1.2. Definisi Operasional Variabel	51
3.1.2.1. Return Saham	51
3.1.2.2. Foreign Inflow	52
3.1.2.3. Inflasi	53
3.1.2.4. Suku bunga	53
3.1.2.5. Nilai Tukar.....	54
3.2. Populasi dan Sampel penelitian.....	56
3.2.1. Populasi	56
3.2.2. Sampel	57
3.3. Jenis dan Sumber Data	57
3.4. Metode Pengumpulan Data	58
3.5. Metode Analisis Data	58
3.5.1. Uji Deskriptif.....	60
3.5.2. Uji Asumsi Klasik	61
3.5.2.1. Uji Normalitas	61
3.5.2.2. Uji Heterokedastisitas.....	62
3.5.2.3. Uji Autokorelasi	63
3.5.2.4. Uji Multikolinearitas	63
3.5.3. Analisis Regresi Linier Berganda.....	64
3.5.3.1. Uji hipotesis secara simultan (Uji F)	65
3.5.3.2. Uji Hipotesis Secara Parsial (Uji t)	66
3.5.3.3. Uji Determinasi	67
BAB IV HASIL DAN PEMBAHASAN	68
4.1. Deskripsi Objek Penelitian	68
4.2. Analisis Data	70
4.2.1. Uji Deskriptif.....	70
4.2.2. Uji Asumsi Klasik	73
4.2.2.1. Uji Normalitas	73
4.2.2.2. Uji Heterokedastisitas.....	75
4.2.2.3. Uji Autokorelasi	77
4.2.2.4. Uji Multikolinearitas	78

4.2.3. Uji Regresi Linier Berganda.....	79
4.2.3.1. Uji Hipotesis secara Simultan (Uji F)	79
4.2.3.2. Uji Hipotesis secara Parsial (Uji t).....	81
4.2.3.3. Uji Determinasi	84
4.3. Interpretasi Hasil	85
BAB V PENUTUP	90
DAFTAR PUSTAKA	94
LAMPIRAN.....	98