

## DAFTAR ISI

HALAMAN JUDUL.....	i
SERTIFIKASI.....	ii
HALAMAN PENGESAHAN.....	iii
MOTTO DAN PERSEMBAHAN.....	iv
ABSTRAK.....	v
ABSTRACT.....	vi
KATA PENGANTAR.....	vii
DAFTAR TABEL.....	ix
DAFTAR GAMBAR.....	x
BAB I PENDAHULUAN.....	1
1.1 Latar Belakang.....	1
1.2 Perumusan Masalah.....	13
1.3 Tujuan dan Kegunaan Penelitian.....	14
BAB II TELAAH PUSTAKA DAN PENGEMBANGAN MODEL.....	16
2.1 Investasi.....	16
2.2 Harga Saham.....	17
2.3 Faktor-faktor yang Mempengaruhi Harga Saham.....	18
2.3.1 Teori Sinyal (Signalling Theory).....	19
2.3.2 Analisis Teknikal.....	19
2.3.3 Volume Perdagangan.....	23
2.3.4 Kebijakan Moneter.....	25

2.3.5 Suku Bunga.....	27
2.3.6 Nilai Tukar Rupiah.....	31
2.3.7 Teori Paritas Daya Beli.....	34
2.4 Indeks Harga Saham.....	34
2.4.1 Indeks LQ45.....	37
2.5 ARIMA ( <i>Autoregressive Integrated Moving Average</i> ).....	40
2.5.1 Model <i>Autoregressive</i> .....	42
2.5.2 Model <i>Moving Average</i> .....	43
2.5.3 Model ARIMA ( <i>Autoregressive Integrated Moving Average</i> ).....	44
2.5.4 Langkah-langkah Metode ARIMA.....	45
2.6 Penelitian Terdahulu.....	48
2.7 Kerangka Teoritis dan Perumusan Hipotesis.....	56
2.7.1 Pengaruh Volume Perdagangan dengan Indeks LQ 45.....	56
2.7.2 Pengaruh Suku Bunga SBI dengan Indeks LQ 45.....	57
2.7.3 Pengaruh Nilai Tukar Mata Uang Asing (Kurs) dengan Indeks LQ 45.....	59
BAB III METODE PENELITIAN.....	62
3.1 Definisi Operasional.....	62
3.2 Jenis Data dan Sumber Data.....	62
3.2.1 Jenis Data.....	62
3.2.2 Sumber Data.....	63
3.3 Populasi dan Sampel.....	63
3.4 Metode Pengumpulan Data.....	63

3.5 Teknik Analisis Data.....	64
3.5.1 Regresi <i>Ordinary Least Square</i> (OLS).....	64
3.5.1.1 Uji Normalitas.....	65
3.5.1.2 Uji Multikolinieritas.....	67
3.5.1.3 Uji Autokorelasi.....	67
3.5.2 Model ARIMA.....	68
3.6 Uji Beda (Uji-t).....	71
BAB IV HASIL DAN ANALISIS.....	72
4.1 Deskripsi Variabel Penelitian.....	74
4.1.2 Volume Perdagangan Saham.....	75
4.1.3 Suku Bunga Deposito.....	76
4.1.4 Kurs (Nilai Tukar).....	77
4.2 Hasil Analisis.....	78
4.2.1 Model OLS.....	78
4.2.1.1 Uji Asumsi Klasik.....	78
4.2.1.2 Pengujian Stastistik Analisis Regresi.....	82
4.2.1.2.1 Uji Signifikansi Parameter Individual (Uji t).....	82
4.2.1.2.2 Uji Signifikansi Simultan.....	86
4.2.1.2.3 Uji Koefisien Determinasi.....	87
4.2.2 Model ARIMA.....	87
4.2.2.1 Uji Stasioneritas (Unit Root Test).....	87
4.2.2.2 Pengujian Autoregresi.....	88
4.2.2.3 Estimasi.....	89

4.2.2.4 Pengujian Hipotesis 4.....	90
BAB V PENUTUP.....	94
5.1 Kesimpulan.....	94
5.2 Implikasi kebijakan.....	95
5.3 Keterbatasan Penelitian.....	96
5.4 Agenda Penelitian Mendatang.....	97
DAFTAR PUSTAKA.....	99
LAMPIRAN	