

## DAFTAR ISI

Halaman Sampul Luar .....	i
Halaman Sampul Dalam .....	ii
Halaman Persetujuan.....	iii
Halaman Pengesahan .....	iv
Pernyataan Keaslian .....	iv
Halaman Motto .....	v
Halaman Persembahan .....	vi
Kata Pengantar .....	vii
Daftar Isi .....	ix
Daftar Tabel .....	xii
Daftar Gambar.....	xiii
Daftar Grafik .....	xiv
Daftar Lampiran .....	xv
Abstrak .....	xvi

### BAB I PENDAHULUAN

A. Latar Belakang Masalah .....	1
B. Identifikasi dan Pembatasan Masalah .....	11
C. Rumusan Masalah .....	13
D. Tujuan Penelitian.....	13
E. Hipotesis Penelitian.....	14
F. Kegunaan Penelitian.....	16
G. Penegasan Istilah .....	17

### BAB II LANDASAN TEORI

A. Deskripsi Teori .....	21
1. Investasi.....	21
2. Pasar Modal.....	23
3. Harga Saham .....	24
4. Inflasi.....	27

5. Nilai Tukar Rupiah.....	31
6. Suku Bunga .....	35
7. Profitabilitas .....	39
B. Penelitian Terdahulu .....	45
C. Kerangka Konseptual .....	59
<b>BAB III METODE PENELITIAN</b>	
A. Rancangan Penelitian .....	62
B. Populasi dan Sampel .....	63
C. Instrumen Penelitian dan Variabel Penelitian .....	65
D. Sumber Data dan Teknik Pengumpulan Data .....	67
E. Teknik Analisis Data .....	69
<b>BAB IV HASIL PENELITIAN</b>	
A. Deskripsi Objek Penelitian .....	79
B. Deskripsi Data .....	96
1. Analisis Statistik Deskriptif .....	96
2. Uji Asumsi Klasik .....	97
3. Analisis Regresi Linier Berganda .....	101
4. Pengujian Hipotesis.....	105
5. Analisis Koefisien Determinasi.....	109
6. Analisis Jalur .....	110
<b>BAB V PEMBAHASAN</b>	
A. Pengaruh Inflasi terhadap Harga Saham .....	115
B. Pengaruh nilai tukar rupiah terhadap Harga Saham .....	117
C. Pengaruh Suku Bunga terhadap Harga Saham.....	118
D. Pengaruh Profitabilitas terhadap Harga Saham.....	120
E. Pengaruh Inflasi terhadap profitabilitas .....	122
F. Pengaruh Nilai Tukar Rupiah terhadap profitabilitas.....	123
G. Pengaruh Suku Bunga terhadap profitabilitas .....	125
H. Pengaruh inflasi, nilai tukar rupiah, dan suku bunga terhadap harga saham melalui profitabilitas .....	127
<b>BAB VI PENUTUP</b>	

A. Kesimpulan .....	131
B. Implikasi .....	133
C. Saran .....	134

#### DAFTAR PUSTAKA

#### LAMPIRAN

## DAFTAR TABEL

Tabel 1.1	Kapitalisasi Indeks Saham JII
Tabel 3.1	Daftar Perusahaan yang terdaftar di JII Periode 2016-2019
Tabel 3.2	Instrumen Penelitian
Tabel 4.1	Tabel <i>Descriptif Statistic</i>
Tabel 4.2	Tabel <i>One-Sample Kolmogorov-Smirnov</i> Uji Normalitas
Tabel 4.3	Tabel <i>Coefficients<sup>a</sup></i> Uji Multikolonieritas
Tabel 4.4	Tabel <i>Model Summary<sup>b</sup></i> Uji Autikorelasi
Tabel 4.5	Tabel <i>Coefficients<sup>a</sup></i> Uji Regresi Linier Berganda Tahap 1
Tabel 4.6	Tabel <i>Coefficients<sup>a</sup></i> Uji Regresi Linier Berganda Tahap 2
Tabel 4.7	Tabel <i>Coefficients<sup>a</sup></i> Uji t Tahap 1
Tabel 4.8	Tabel <i>Coefficients<sup>a</sup></i> Uji t Tahap 2
Tabel 4.9	Tabel ANOVA <sup>a</sup> Uji F
Tabel 4.10	Tabel <i>Model Summary<sup>b</sup></i> Uji Koefisien Determinasi Tahap 1
Tabel 4.11	Tabel <i>Model Summary<sup>b</sup></i> Uji Koefisien Determinasi Tahap 2
Tabel 4.12	Rangkuman Analisis Jalur

## DAFTAR GAMBAR

Gambar 2.1 Kerangka Konseptual

Gambar 4.1 *Scatterplot* Uji Heteroskedastisitas

Gambar 4.2 Hubungan variabel  $X_1$  terhadap Y melalui Z

Gambar 4.3 Hubungan variabel  $X_2$  terhadap Y melalui Z

Gambar 4.4 Hubungan variabel  $X_3$  terhadap Y melalui Z

Gambar 4.5 Diagram Jalur

## **DAFTAR GRAFIK**

Grafik 1.1 Grafik Fluktuasi Inflasi

Grafik 1.2 Grafik Fluktuasi Nilai Tukar Rupiah

Grafik 1.3 Grafik Fluktuasi Suku Bunga

## **DAFTAR LAMPIRAN**

Lampiran 1 Daftar nama perusahaan pada JII yang menjadi sampel penelitian

Lampiran 2 Tabulasi Data

Lampiran 3 Analisis Statistik Deskriptif

Lampiran 4 Uji Asumsi Klasik

Lampiran 5 Analisis Regresi Linier Berganda

Lampiran 6 Uji Hipotesis

Lampiran 7 Analisis Koefisien Determinasi ( $R^2$ )

Lampiran 8 Diagram Jalur