

DAFTAR ISI

	Halaman
HALAMAN JUDUL	i
HALAMAN PERSETUJUAN	ii
HALAMAN PERNYATAAN	iii
KATA PENGANTAR	iv
DAFTAR ISI	vi
DAFTAR TABEL	x
DAFTAR LAMPIRAN	xi
<i>ABSTRACT</i>	xii
INTISARI	xiii
BAB I PENDAHULUAN	
1.1. Latar Belakang Masalah.....	1
1.2. Perumusan Masalah.....	4
1.3. Batasan Masalah.....	4
1.4. Tujuan Penelitian.....	5
1.5. Manfaat Penelitian.....	6
1.6. Sistematika Penulisan.....	6

BAB II	TINJAUAN PUSTAKA	
2.1.	Beberapa Hasil Penelitian Sebelumnya.....	8
2.2.	Landasan Teori.....	14
2.2.1.	Analisis Fundamental.....	14
2.2.2.	Keuntungan dan Resiko Saham.....	16
2.2.3.	Arbitage Pricing Theory.....	17
2.3.	Perumusan Hipotesis.....	21
2.3.1	Hubungan interelasi antara indikator-indikator Makroekonomi dan moneter dengsn <i>return</i> indeks saham LQ-45	21
2.3.2.	Hubungan antara-indikator makroekonomi dan moneter setelah penseleksian (<i>backward</i>) dengan <i>return</i> indeks saham LQ-45...	21
2.4.	Rencana Penelitian.....	28
2.4.1.	Pengujian Hipotesis.....	28
2.4.1.1	Uji Secara Individu.....	29
2.4.1.2	Uji Secara Serentak	29
2.4.2.	Uji Penyimpangan Asumsi Model Klasik.....	29
2.4.2.1.	Uji Multikolinieritas.....	30
2.4.2.2.	Uji Heterokedastisitas.....	30
2.4.2.3	Uji Otokorelasi.....	31

BAB III	METODOLOGI PENELITIAN	
3.1.	Materi Penelitian.....	32
3.2.	Variabel dan Pengukurannya.....	32
3.3.	Definisi Operasional Variabel.....	33
3.3.1.	Kelemahan Variabel.....	35
3.4.	Teknik Pengumpulan Data.....	35
3.5.	Metode Analisis dan Estimasi Data.....	36
BAB IV	HASIL PENELITIAN DAN PEMBAHASAN	
4.1.	Data Deskriptif.....	43
4.2.	Pengaruh indikator Makro Ekonomi terhadap Return Indeks Saham LQ-45.....	45
4.2.1.	Uji Hipotesis 1.....	45
4.2.2.	Uji Hipotesis 2.....	48
4.2.2.1	Risiko Pasar.....	49
4.2.2.2.	Inflasi.....	50
4.2.2.3	Nilai Tukar Rupiah terhadap Dollar Amerika.....	51
4.2.2.4.	Suku Bunga Sertifikat Bank Indonesia.....	53
4.2.2.5.	Suku Bunga Deposito Berjangka satu bulan.....	54
4.2.2.6.	Jumlah Uang Beredar.....	55
4.2.2.6.1	M1 (Uang Kartal dan Uang Giral).....	55

4.2.2.6.2	M2 (M1 ditambah Uang Kuasi).....	56
4.2.3.	Uji Asumsi Klasik.....	57
4.2.3.1.	Uji Multikolinieritas.....	57
4.2.3.2.	Uji Otokorelasi.....	58
4.2.3.3.	Uji Heteroskedastisitas.....	58
BAB V	KESIMPULAN DAN SARAN	
5.1.	Kesimpulan.....	60
5.2.	Keterbatasan Penelitian.....	63
5.3.	Implikasi.....	64
5.4.	Saran-Saran.....	65
DAFTAR PUSTAKA		67
LAMPIRAN		70

DAFTAR TABEL

		Halaman
Tabel 4.1	Statistik Deskriptif.....	43
Tabel 4.2	Hasil Analisis Regresi.....	46
Tabel 4.3	Hasil Analisis Regresi.....	49
Tabel 4.4	Hasil Uji Heteroskedastisitas.....	59

DAFTAR LAMPIRAN

		Halaman
Lampiran 1	Tabel data-data dasar penelitian.....	70
Lampiran 2	Hasil Analisis Regresi Hipotesis-1.....	72
Lampiran 3	Hasil Uji Multikolinieritas.....	73
Lampiran 4	Hasil Uji Otokorelasi.....	74
Lampiran 5	Hasul Uji Heterokedastisitas.....	75
Lampiran 6	Hasil Analisis Regresi Hipotesis-2.....	76
Lampiran 7	Hasil Uji Multikolinieritas.....	77
Lampiran 8	Hasil Uji Otokorelasi.....	78
Lampiran 9	Hasul Uji Heterokedastisitas.....	79