

LEMBAR JUDUL	i
LEMBAR PENGESAHAN	ii
LEMBAR PERNYATAAN	iii
KATA PENGANTAR	iv
DAFTAR ISI	vi
DAFTAR TABEL	x
DAFTAR GAMBAR	xi
DAFTAR LAMPIRAN	xii
INTISARI	xiii
ABSTRACT	xiv
BAB I. PENDAHULUAN	1
1.1 Latar Belakang Masalah	1
1.2 Perumusan Masalah	15
1.3 Batasan Masalah	15
1.4 Tujuan Penelitian	16
1.5 Manfaat Penelitian	16
1.6 Sistematika Penulisan	17
BAB II. LANDASAN TEORI	18
2.1 Pengertian Pasar Modal	18
2.2 Fungsi Pasar Modal	19
2.3 Sekuritas Pasar Modal	21



2.5 Indeks Harga Saham Gabungan	25
2.6 Indeks Individual	25
2.7 Indeks LQ-45	26
2.8 <i>Jakarta Islamic Index (JII)</i>	27
2.9 Indeks Sektoral	27
2.10 Batu Bara	29
2.10.1 Jenis-jenis Batu Bara	30
2.10.2 Penggunaan Batu Bara	31
2.10.3 Batu Bara dan Pasar Global	32
2.10.4 Batu Bara di Indonesia	34
2.10.5 Produksi, Konsumsi, dan Ekspor Batu Bara	36
2.11 Nilai Tukar	37
2.11.1 Nilai Tukar (Kurs Tetap)	38
2.11.2 Nilai Tukar (Kurs Mengambang)	38
2.11.3 Paritas Daya Beli (<i>Purchasing Power Parity</i>)	40
2.12 Minyak Mentah Dunia	41
2.12.1 Patokan Harga Minyak Mentah	42
2.13 <i>Brent Crude Oil</i>	44
2.14 Kerangka Pemikiran Teoritis	45
2.15 Pengaruh Harga Minyak Mentah Dunia Terhadap Indeks Sektor Pertambangan	47
2.16 Pengaruh Harga Batubara Dunia Terhadap Indeks Sektor Pertambangan	49

Sektor Pertambangan	50
BAB III. METODA PENELITIAN	53
3.1 Jenis Penelitian	53
3.2 Deskripsi Data	53
3.3 Data dan Sumber Data	55
3.4 Definisi dan Pengukuran Variabel Penelitian	55
3.5 Uji Asumsi Klasik	57
3.5.1 Uji Heteroskedastisitas	58
3.5.2 Uji Autokorelasi	59
3.5.3 Uji Multikolinearitas	60
3.5.4 Uji Normalitas	61
3.6 Metode Analisis Regresi Linear Berganda	62
3.7 Uji Statistik	62
3.7.1 Analisis Korelasi Ganda (Uji R)	62
3.7.2 Analisis Determinasi (Uji R ²)	63
3.7.3 Uji Koefisien Regresi (Uji t)	63
3.7.4 Uji Koefisien Regresi Secara Bersama-sama (Uji F)	64
BAB IV. ANALISIS DATA	65
4.1 Pendahuluan	65
4.2 Deskripsi Statistik	66
4.4 Uji Asumsi Klasik	67
4.5 Uji Heteroskedastisitas	68



UNIVERSITAS
GADJAH MADA

Analisis pengaruh harga minyak mentah dunia, harga batubara dunia dan nilai tukar terhadap indeks sektor pertambangan pada tahun 2005-2009

NOER, Adrian, Nugyanto Hartono M., Prof., Dr., M.B.A 02

Universitas Gadjah Mada, 2010 | Diunduh dari <http://etd.repository.ugm.ac.id/>

3.4 Uji Multikolinearitas	71
3.4 Uji Normalitas	73
3.4 Model Persamaan Linear Berganda	75
3.4 Uji Statistik	77
3.4 Analisis Korelasi Ganda (Uji R)	77
3.4 Analisis Determinasi (Uji R^2)	78
3.4 Uji Koefisien Regresi (Uji t)	79
3.4 Uji Koefisien Regresi Secara Bersama-sama (Uji F)	82
BAB V. PENUTUP	83
5.1 Kesimpulan	83
5.2 Keterbatasan dan Saran untuk Penelitian Selanjutnya	85
5.2.1 Keterbatasan	85
5.2.2 Saran	86

DAFTAR PUSTAKA

LAMPIRAN



Tabel 1.1 Perkembangan Bursa Efek Indonesia Tahun 1994-2009	6
Tabel 1.2 Kapitalisasi Pasar per Sektor Ekonomi 2009	8
Tabel 1.3 Transaksi Perdagangan Per Industri Pertambangan	9
Tabel 1.4 Transaksi Pertambangan Per Perusahaan	10
Tabel 1.5 Produksi, Konsumsi, Exim Minyak Bumi Per Tahun (Barel)	13
Tabel 1.5 Produksi, Domestik, Ekspor Batubara Per Tahun (Ton)	14
Tabel 2.1 Negara Pengimpor Utama Batubara	34
Tabel 2.2 Pengguna Batubara per Sektor Usaha	37
Tabel 3.1 Emiten Sektor Pertambangan	54
Tabel 3.2 Deskripsi Variabel	56
Tabel 4.1 Deskripsi Statistik	66
Tabel 4.2 Uji Durbin Watson	71
Tabel 4.3 Uji VIF	73
Tabel 4.4 Model Regresi	75
Tabel 4.5 Uji R	78
Tabel 4.6 Uji t	79
Tabel 4.7 Anova	82



Gambar 1.1 Produksi, Konsumsi, Ekspor-Impor Minyak Bumi di Indonesia	
.....	13
Gambar 1.2 Produksi, Domestik, Ekspor Batubara di Indonesia	14
Gambar 2.1 Pasar Keuangan	19
Gambar 2.2 Jenis Batubara	31
Gambar 2.3 Kerangka Pemikiran Teoritis	47
Gambar 4.1 Scatter Plot	69
Gambar 4.2 Grafik Normal P-Plot	74



Lampiran 1. Data Harga Minyak Mentah, Harga Batubara Dunia, Kurs Rp/US\$, dan Nilai Indeks Sektor Pertambangan periode Tahun 2005 - 2009	
.....	90
Lampiran 2. Uji t	97
Lampiran 3. Uji R, R²	98
Lampiran 4. Uji F	99