

DAFTAR ISI

	Halaman
Halaman Judul	i
Halaman Pernyataan Bebas Plagiarisme.....	ii
Halaman Pengesahan Skripsi.....	iii
Halaman Pengesahan Ujian	iv
Halaman Motto.....	v
Halaman Persembahan.....	vi
Halaman Kata Pengantar	vii
Halaman Daftar Isi	x
Halaman Daftar Tabel	xiv
Halaman Daftar Gambar	xv
Halaman Daftar Lampiran	xvi
Halaman Abstrak.....	xvii
 BAB I PENDAHULUAN	 1
1.1. Latar Belakang Masalah	1
1.2. Rumusan Masalah penelitian.....	7
1.3. Tujuan dan Manfaat Penelitian	7
1.4. Sistematika Penulisan Skripsi	8

BAB II TINJAUAN UMUM SUBYEK PENELITIAN	10
2.1. Sejarah Pasar Modal Indonesia.....	10
2.2. Para Pelaku Pasar Modal.....	14
2.2.1. Badan Pengawas Pasar Modal.....	14
2.2.2. Emiten.....	15
2.2.3. Investor.....	16
2.2.4. Penjamin Emisi (underwriter).....	16
2.2.5. Perantara Perdagangan Efek (Pialang atau Broker), Pedagang Efek (Dealer), dan Perusahaan Efek.....	18
2.2.6. Badan Pengelola Bursa.....	19
2.2.7. Lembaga-Lembaga Pendukung Pasar Modal.....	20
2.2.8. Penjamin (Guarantor).....	21
2.2.9. Wali Amanat.....	21
2.3. Jenis-Jenis Efek di Pasar Modal Indonesia.....	22
2.3.1. Saham.....	22
2.3.2. Saham Preferen.....	24
2.3.3. Rights.....	24
2.3.4. Waran.....	25
2.3.5. Obligasi.....	25
2.3.6. Reksa Dana.....	26
2.4. Sistem Perdagangan Efek di Bursa Efek Jakarta.....	27
2.5. PT Bank BRI Tbk.....	29
BAB III KAJIAN PUSTAKA	32

BAB IV LANDASAN TEORI DAN HIPOTESIS.....	35
4.1. Landasan Teori.....	35
4.1.1. Investasi	35
4.1.2. Saham.....	36
4.1.3. Nilai Tukar Rupiah.....	37
4.1.4. Tingkat Bunga.....	38
4.1.5. Indeks Harga Saham.....	39
4.1.6. Berbagai yang Mempengaruhi Indeks Harga Saham.....	40
4.2. Hipotesa Penelitian.....	41
BAB V METODE PENELITIAN	44
5.1. Jenis dan Sumber Data	44
5.2. Metode Analisis Data	45
5.2.1. Spesifikasi Pemilihan Model Regresi.....	46
5.3. Pengujian Koefisien Determinasi	47
5.4. Pengujian Hipotesis	48
5.4.1. Uji t	48
5.5.1 Uji F	48
5.5.2. Uji Asumsi Klasik	49
5.5.2.1. Uji Multikolinieritas	49
5.5.2.2. Uji Heterokedastisitas	50
5.5.2.3. Uji Autokorelasi	50
BAB VI ANALISIS DAN PEMBAHASAN.....	52

6.1.	Analisa Hasil Regresi.....	52
6.1.1.	Pemilihan Model Regresi.....	53
6.2.	Pengujian Koefisien Determinasi.....	53
6.3.	Pengujian hipotesis.....	54
6.3.1.	Pengujian Koefisien Regresi Secara Parsial.....	54
6.3.1.1.	Uji t terhadap nilai tukar Rupiah terhadap US Dollar.....	54
6.3.1.2.	Uji t terhadap suku bunga deposito berjangka 3 bulan.....	55
6.3.1.3.	Uji t terhadap indeks harga saham gabungan.....	55
6.3.2.	Pengujian Koefisien Regresi Secara Serempak.....	56
6.3.3.	Uji Asumsi Klasik.....	57
6.3.3.1.	Uji Multikolinieritas.....	57
6.3.3.2.	Uji Heterodastisitas.....	58
6.3.3.3.	Uji Autokorelasi.....	58
6.4.	Analisa Hasil Estimasi.....	60
BAB VII KESIMPULAN DAN IMPLIKASI.....		62
7.1.	Kesimpulan	62
7.2.	Implikasi	63
DAFTAR PUSTAKA		65

DAFTAR TABEL

Tabel	Halaman
1. Perkembangan Volume Perdagangan Saham Di Bursa Efek Jakarta Tahun 1999-2004.....	1
2. Perkembangan Nilai Kapitalisasi Pasar Saham di Bursa Efek Jakarta Tahun 2000-2004.....	2
3. Perkembangan harga saham dalam Rupiah antara PT Bank Mandiri Tbk, PT Bank BNI Tbk, dan PT Bank BRI Tbk bulan Juli 2005.....	5
6.1. Hasil Regresi.....	52
6.2. Hasil Uji MWD.....	53
6.3. Hasil Pengujian secara Parsial.....	54
6.4. Uji Multikolinieritas.....	57

DAFTAR GAMBAR

Gambar	Halaman
6.1. Daerah Pengujian F test.....	57
6.2. Grafik Uji Durbin Watson.....	59
6.3 Grafik Uji Durbin Watson.....	59



DAFTAR LAMPIRAN

Lampiran	Halaman
I Daftar (Mingguan) Nilai Tukar Rupiah terhadap US \$, Suku Bunga Deposito Bank 3 Bulan, Indeks Harga Saham Gabungan, dan Harga Saham PT BANK BRI Tbk....	66
II Hasil Regresi.....	68
III Hasil Uji MWD.....	69
IV Uji Multikolinieritas.....	70
V Uji Heterodastisitas.....	73
VI Uji Penyembuhan Autokorelasi.....	74