DAFTAR ISI

HALAMAN JUDUL i
HALAMAN PERSETUJUAN DOSEN PEMBIMBING ii
HALAMAN PENGESAHAN iii
KATA PENGANTAR iv
DAFTAR ISI vi
DAFTAR TABEL viii
DAFTAR GAMBAR x
DAFTAR LAMPIRAN xi
DAFTAR ISTILAH xii
DAFTAR SIMBOL xiii
PERNYATAAN xiv
INTISARI xv
ABSTRACT xvi
BAB I PENDAHULUAN 1
1.1. Latar Belakang Masalah 1
1.3. Tujuan Penelitian 5
1.4. Manfaat Penelitian 5
1.5. Batasan Penelitian 5
BAB II KAJIAN PUSTAKA 7
BAB III LANDASAN TEORI 12
3.1. Saham 12
3.1.1. Pengertian Saham 12
3.1.2. Jenis-Jenis Saham 14
3.2. Harga Saham 15
3.2.1. Pengertian Harga Saham 15
3.2.2. Jenis-Jenis Harga Saham 16
3.2.3. Faktor yang Mempengaruhi Harga Saham 18
3.3. Nilai Tukar (Kurs) 19
3.3.1. Pengertian Nilai Tukar (Kurs) 19

3.3.2. Faktor yang Mempegaruhi Kurs 21
3.3.3. Sistem Kurs 22
3.3.4. Fluktuasi Kurs 22
3.4. Perusahaan Pertambangan 23
3.5. Data Longitudinal 24
3.6. Analisis Regresi Linear Sederhana dengan Metode *Ordinary Least Square* (OLS) 26
3.7. Uji Asumsi Klasik 32
3.8. Regresi Nonparametrik *Spline Truncated* 40
3.9. Pemilihan Titik *Knot* Optimum 47
3.10. Kriteria *Mean Absolute Percentage Error* (MAPE) 48
3.11. Single Value Decomposition 49
BAB IV METODOLOGI PENELITIAN 52
4.1 Tempat dan Waktu Penelitian 52
4.2 Variabel Penelitian 52
4.3 Teknik Pengumpulan Data 52
4.4 Alat Penelitian 53
4.5 Metode Analisis Data 53
4.6 Tahapan Penelitian 53
BAB V HASIL DAN PEMBAHASAN 56
5.1 Analisis Deskriptif 56
5.2 *Scatterplot* 61
5.3 Pemilihan Titik *Knot* Optimum pada Regresi *Spline Truncated* 63
5.4 Pemodelan Regresi *Spline Truncated* 67
5.4.1. PT Adaro Energy Tbk 69
5.4.2. PT Aneka Tambang Tbk 70
5.4.3. PT Indo Tambangraya Megah Tbk 71
5.5. Pemodelan Regresi Linear Sederhana 72
5.5.1. PT Adaro Energy Tbk 72
5.5.2. PT Aneka Tambang Tbk 73
5.5.3. PT Indo Tambangraya Megah Tbk 73

5.6. Perbandingan Regresi *Spline Truncated* dengan Regresi Linear Sederhana.....75
5.7. Pengujian Menggunakan Data *Out Sample*.....77
BAB VI KESIMPULAN DAN SARAN 78
6.1. Kesimpulan 78
6.2. Saran.....79
DAFTAR PUSTAKA 80
LAMPIRAN..... 83