

DAFTAR ISI

HALAMAN JUDUL	i
PERSETUJUAN PEMBIMBING SKRIPSI	ii
PENGESAHAN MUNAQOSYAH.....	iii
PERNYATAAN KEASLIAN SKRIPSI.....	iv
ABSTRAK	v
MOTO.....	vi
PERSEMBAHAN.....	vii
PEDOMAN TRANSLITERASI ARAB-LATIN	viii
KATA PENGANTAR	ix
DAFTAR ISI.....	xi
DAFTAR TABEL.....	xiii
DAFTAR GAMBAR/GRAFIK	xiv
BAB I.....	1
PENDAHULUAN.....	1
A. Latar Belakang	1
B. Rumusan Masalah.....	7
C. Tujuan Penelitian	8
D. Manfaat Penelitian	8
E. Sistematika Penulisan	9
BAB II	11
LANDASAN TEORI.....	11
A. Deskripsi Teori.....	11
1. Hipotesa Pasar Efisien (<i>Efficient Market Hypothesis</i>).....	11
2. Analisis Fundamental.....	12
3. Analisis Teknikal	14
4. Analisis Makro Ekonomi	17
5. Pasar Modal	20
6. Investasi	25
7. Saham	27
8. Indeks Harga Saham	29
B. Penelitian Terdahulu	31
C. Kerangka Berfikir	38
D. Hipotesis	39
BAB III.....	43
METODE PENELITIAN	43
A. Jenis dan Pendekatan	43
B. <i>Setting</i> Penelitian	43
C. Populasi dan Sampel	44
D. Desain dan Definisi Operasional Variabel	45
E. Teknik Pengumpulan Data.....	47

F. Teknis Analisis Data	48
1. Uji Asumsi Klasik.....	48
2. Regresi Linear Berganda.....	51
3. Uji Hipotesis	52
BAB IV	54
HASIL PENELITIAN DAN PEMBAHASAN	54
A. Hasil Penelitian	54
1. Gambaran Obyek Penelitian.....	54
2. Analisis Data.....	57
B. Pembahasan	72
1. Aspek Fundamental Terhadap Harga Saham yang Terdaftar MSCI Indonesia <i>Small Cap Index</i>	72
2. Aspek Teknikal (MACD) Terhadap Harga Saham yang Terdaftar MSCI <i>Small Cap Index</i>	74
3. Aspek Makro Ekonomi Terhadap Harga Saham yang Terdaftar MSCI <i>Small Cap Index</i>	75
BAB V	78
PENUTUP.....	78
A. Kesimpulan	78
B. Saran-Saran.....	78
DAFTAR PUSTAKA	80
LAMPIRAN-LAMPIRAN.....	83

DAFTAR TABEL

Tabel 1.1.	Daftar Saham MSCI Indonesia Small Cap Index	2
Tabel 2.1.	Perkembangan Pasar Modal di Indonesia.....	21
Tabel 2.2.	Penelitian Terdahulu	31
Tabel 3.1.	Sampel Penelitian.....	44
Tabel 3.2.	Desain dan Definisi Operasional Variabel	45
Tabel 4.1.	Data Kinerja Tahunan (<i>Annual Performance</i>) MSCI Indonesia <i>Small Cap Index</i> per Tahun 2009 – Tahun 2022	56
Tabel 4.2.	Hasil Uji Statistik Deskriptif	58
Tabel 4.3.	Hasil Uji Normalitas dengan <i>One Sample Kolmogorov Smirnov</i>	60
Tabel 4.4.	Hasil Uji Multikolinearitas.....	62
Tabel 4.5.	Hasil Uji Heteroskedastisitas dengan Uji Glejser.....	63
Tabel 4.6.	Hasil Uji Autokorelasi	65
Tabel 4.7.	Persamaan Regresi Linear Berganda.....	65
Tabel 4.8.	Hasil Uji Koefisien Determinasi	67
Tabel 4.9.	Hasil Uji t.....	69
Tabel 4.10.	Hasil Uji F.....	71

DAFTAR GAMBAR/GRAFIK

Gambar 1.1. Perubahan Harga Saham MSCI Indonesia <i>Small Cap</i> per November 2021	2
Gambar 2.1. Tren Pergerakan Harga Saham BEBS	15
Gambar 2.2. Tren Pergerakan Harga Saham DMMX.....	15
Gambar 2.3. Tren Pergerakan Harga Saham MCAS	16
Gambar 2.4. Tren Pergerakan Harga Saham SILO	16
Gambar 2.5. Tren Pergerakan Harga Saham INDY	17
Gambar 2.6. Tahapan Memulai Investasi.....	27
Gambar 2.7. Kerangka Berfikir.....	39
Gambar 4.1. Kinerja Indeks Kumulatif MSCI Indonesia <i>Small Cap Index</i> , <i>MSCI Emerging Markets</i> , dan <i>MSCI ACWI</i> (per Feb 2008 – Feb 2023)	56
Gambar 4.2. Hasil Uji Normalitas dengan Grafik Normal P-P Plot of Regression Standardized Residual.....	61
Gambar 4.3. Hasil Uji Heteroskedastisitas dengan Grafik <i>Scatterplots</i>	64

