

Hak Cipta Dilindungi Undang-Undang

1. Dilarang mengutip sebagian atau seluruh karya tulis ini tanpa mencantumkan dan menyebutkan sumber:

a. Pengutipan hanya untuk kepentingan pendidikan, penelitian, penulisan karya ilmiah, penyusunan laporan, penulisan kritik atau tinjauan suatu masalah.

b. Pengutipan tidak merugikan kepentingan yang wajar UIN Suska Riau.

2. Dilarang mengumumkan dan memperbanyak sebagian atau seluruh karya tulis ini dalam bentuk apapun tanpa izin UIN Suska Riau.

BAB III

METODE PENELITIAN

3.1 Jenis dan Sumber Data

Jenis data terbagi dua yaitu data primer dan data sekunder. Data primer adalah data yang diperoleh atau dikumpulkan oleh peneliti secara langsung dari sumber datanya. Sedangkan data sekunder adalah data yang diperoleh atau dikumpulkan peneliti dari berbagai sumber yang telah ada. Jenis data yang digunakan dalam penelitian ini adalah data sekunder. Data sekunder merupakan sumber data penelitian yang diperoleh peneliti secara tidak langsung melalui media perantara (diperoleh atau dicatat oleh pihak lain). Data sekunder umumnya berupa bukti, catatan atau laporan historis yang telah tersusun dalam setiap arsip (data documenter) yang dipublikasikan dan tidak dipublikasikan yang diperoleh dari objek penelitian (perusahaan). Sumber yang dipakai untuk mendapatkan data - data tersebut dengan melakukan pengunduhan melalui situs website www.bps.go.id, www.bi.go.id, www.investing.com.

3.2 Teknik Pengumpulan Data

Metode pengumpulan data yang digunakan oleh penulis dalam penelitian ini adalah dokumentasi. Dokumentasi adalah teknik pengumpulan data yang dilakukan dengan cara mencatat atau mengumpulkan dari buku, jurnal, penelitian terdahulu, internet, instansi atau lembaga pemerintah dan juga data-data yang dimiliki perusahaan sesuai dengan keperluan pembahasan dalam penelitian.

Hak Cipta Dilindungi Undang-Undang

1. Dilarang mengutip sebagian atau seluruh karya tulis ini tanpa mencantumkan dan menyebutkan sumber:
 - a. Pengutipan hanya untuk kepentingan pendidikan, penelitian, penulisan karya ilmiah, penyusunan laporan, penulisan kritik atau tinjauan suatu masalah.
 - b. Pengutipan tidak merugikan kepentingan yang wajar UIN Suska Riau.
2. Dilarang mengumumkan dan memperbanyak sebagian atau seluruh karya tulis ini dalam bentuk apapun tanpa izin UIN Suska Riau.

3.3 Populasi dan Sampel

Populasi adalah wilayah generalisasi yang terdiri atas obyek atau subyek yang mempunyai kualitas dan karakteristik tertentu yang ditetapkan oleh peneliti untuk dipelajari dan kemudian ditarik kesimpulannya (Sugiyono, 2014). Dalam penelitian ini populasi yang diambil adalah seluruh data Indeks Harga Saham Gabungan (IHSG) di Bursa Efek Indonesia, inflasi, nilai tukar rupiah (IDR/USD).

Sampel adalah bagian dari jumlah dan karakteristik yang dimiliki oleh populasi tersebut (Sugiyono, 2014). Teknik sampel ini menggunakan teknik sampling jenuh. Menurut Sugiyono (2012) sampling jenuh adalah teknik penentuan sampel bila semua anggota populasi digunakan sebagai sampel.. Data yang digunakan sebagai sampel dalam penelitian ini adalah data Indeks Harga Saham Gabungan (IHSG), inflasi, nilai tukar rupiah (IDR/USD).

3.4 Teknik Analisis Data

Metode analisis data adalah suatu metode yang digunakan untuk mengolah data hasil penelitian guna memperoleh suatu kesimpulan. Metode analisis data yang digunakan pada penelitian ini adalah metode analisis linier berganda dengan bantuan pengolahan data dan perhitungannya dengan menggunakan program *Microsoft Office Excel* dan *SPSS (Statistical Product and Service Solution)* versi 25. Sebelum melakukan uji hipotesis, dilakukan uji asumsi klasik terlebih dahulu yang terdiri dari uji normalitas, uji autokorelasi, uji heteroskedalitas, dan uji multikolinieritas. Dilanjutkan dengan uji hipotesis yang menggunakan uji parsial (T), uji simultan (F) dan koefisien determinasi (R^2)

Hak Cipta Diindungi Undang-Undang

1. Dilarang mengutip sebagian atau seluruh karya tulis ini tanpa mencantumkan dan menyebutkan sumber:
 - a. Pengutipan hanya untuk kepentingan pendidikan, penelitian, penulisan karya ilmiah, penyusunan laporan, penulisan kritik atau tinjauan suatu masalah.
 - b. Pengutipan tidak merugikan kepentingan yang wajar UIN Suska Riau.
2. Dilarang mengumumkan dan memperbanyak sebagian atau seluruh karya tulis ini dalam bentuk apapun tanpa izin UIN Suska Riau.

3.4.1 Uji Asumsi Klasik

Sebelum dilakukan pengujian regresi berganda, perlu dilakukan suatu pengujian asumsi klasik agar model regresi menjadi suatu model yang lebih representatif. Uji asumsi klasik yang digunakan pada penelitian ini adalah uji normalitas data, uji multikolonieritas, uji heteroskedastisitas, dan uji autokorelasi yang digunakan karena data yang digunakan dalam penelitian ini lebih dari satu tahun.

3.4.1.1 Uji Normalitas Data

Menurut Suliyanto (2011:69) Uji normalitas dimaksudkan untuk menguji apakah nilai residual yang telah distandarisasi pada model regresi pendistribusi normal atau tidak. Pengujian normalitas dalam penelitian ini dilakukan dengan menggunakan analisis statistik. Uji statistik yang digunakan untuk menguji normalitas adalah uji statistik *nonparametrik One kolmogorov Smirnov*. Kriteria nilai ditentukan sebagai berikut.

Jika angka probabilitas $< \alpha = 0,05$ maka variabel tidak berdistribusi secara normal. Sebaliknya, bila angka probabilitas $> \alpha = 0,05$ maka variabel terdistribusi secara normal.

3.4.1.2 Uji Multikolonieritas

Menurut Gujarati (2011:63) Uji multikolonieritas dilakukan untuk melihat seberapa eratny hubungan antar variabel bebas. Untuk mendeteksi ada atau tidaknya multikolonieritas dalam model regresi adalah dengan melihat nilai *Tolerance* dan nilai *Variance Inflation Factor (VIF)*. Batas *Tolerance Value*

Hak Cipta Diindungi Undang-Undang

1. Dilarang mengutip sebagian atau seluruh karya tulis ini tanpa mencantumkan dan menyebutkan sumber:

- a. Pengutipan hanya untuk kepentingan pendidikan, penelitian, penulisan karya ilmiah, penyusunan laporan, penulisan kritik atau tinjauan suatu masalah.
- b. Pengutipan tidak merugikan kepentingan yang wajar UIN Suska Riau.

2. Dilarang mengumumkan dan memperbanyak sebagian atau seluruh karya tulis ini dalam bentuk apapun tanpa izin UIN Suska Riau.

adalah 0,1 dan batas VIF adalah 10. Apabila *Tolerance Value* $< 0,1$ atau $VIF > 10$ maka terjadi multikolonieritas. Sebaliknya, apabila *Tolerance Value* $> 0,1$ atau $VIF < 10$ maka tidak terjadi multikolonieritas.

Menurut Suliyanto (2011:81) Uji multikolonieritas berarti tidak terjadi korelasi linier yang mendekati sempurna antar lebih dari dua variabel bebas. Uji multikolonieritas bertujuan untuk menguji apakah model regresi yang terbentuk ada korelasi yang tinggi atau sempurna diantara variabel bebas atau tidak. Jika dalam regresi yang terbentuk terdapat korelasi yang tinggi atau sempurna diantara variabel bebas maka regresi tersebut dinyatakan mengandung gejala multikolonieritas. Multikolonieritas berarti variabel bebas yang satu dengan variabel bebas yang lain dalam model regresi saling berkorelasi linier, biasanya korelasinya mendekati sempurna.

3.4.1.3 Uji Heteroskedastisitas

Heteroskedastisitas berarti ada varian variabel pada model regresi yang tidak sama (konstan). Sebaliknya, jika varian variabel pada model regresi memiliki nilai yang sama (konstan) maka disebut dengan homoskedastisitas. Penelitian ini menggunakan metode glejser dengan cara meregresikan semua variabel bebas terhadap nilai mutlak residualnya dengan tingkat kesalahan (α) sebesar 5%. Jika terdapat pengaruh variabel bebas yang signifikan terhadap nilai mutlak residualnya maka dalam model terdapat masalah heteroskedastisitas. Jika β signifikan maka terdapat pengaruh variabel bebas terhadap nilai residual mutlak sehingga dinyatakan bahwa terdapat gejala heteroskedastisitas, demikian pula sebaliknya.

Hak Cipta Dilindungi Undang-Undang

1. Dilarang mengutip sebagian atau seluruh karya tulis ini tanpa mencantumkan dan menyebutkan sumber:
 - a. Pengutipan hanya untuk kepentingan pendidikan, penelitian, penulisan karya ilmiah, penyusunan laporan, penulisan kritik atau tinjauan suatu masalah.
 - b. Pengutipan tidak merugikan kepentingan yang wajar UIN Suska Riau.
2. Dilarang mengummumkan dan memperbanyak sebagian atau seluruh karya tulis ini dalam bentuk apapun tanpa izin UIN Suska Riau.

3.4.1.4 Uji Autokorelasi

Menurut Sulyanto (2011:87) Uji autokorelasi adalah keadaan dimana terjadi korelasi antara variabel residual pada satu pengamatan lain pada model regresi. Uji autokorelasi digunakan untuk mengetahui ada atau tidaknya korelasi yang terjadi pada residual pada suatu pengamatan lain pada model regresi. Ada tidaknya autokorelasi dalam penelitian ini dideteksi dengan menggunakan metode *Run Test*.

3.4.2 Analisis Regresi Linier Berganda

Metode analisis yang digunakan dalam penelitian ini adalah analisis regresi linier berganda untuk memperoleh gambaran yang menyeluruh mengenai pengaruh antar variabel dependen yaitu indeks harga saham gabungan dan variabel independen yaitu nilai tukar, volume perdagangan, tingkat suku bunga, dan inflasi. Persamaan regresi linier berganda sebagai berikut :

$$Y = a + b_1X_1 + b_2X_2 + b_3X_3 + b_4X_4 + e$$

Dimana :

- | | |
|----------------|--|
| Y | : Indeks Harga saham gabungan |
| a | : Konstanta |
| b ₁ | : Koefisien Regresi Nilai Tukar |
| b ₂ | : Koefisien Regresi Volume Perdagangan |
| b ₃ | : Koefisien Regresi Tingkat Suku Bunga |
| b ₄ | : Koefisien Regresi Inflasi |
| X ₁ | : Nilai Tukar |
| X ₂ | : Volume Perdagangan |

Hak Cipta Dilindungi Undang-Undang

1. Dilarang mengutip sebagian atau seluruh karya tulis ini tanpa mencantumkan dan menyebutkan sumber:
 - a. Pengutipan hanya untuk kepentingan pendidikan, penelitian, penulisan karya ilmiah, penyusunan laporan, penulisan kritik atau tinjauan suatu masalah.
 - b. Pengutipan tidak merugikan kepentingan yang wajar UIN Suska Riau.
2. Dilarang mengumumkan dan memperbanyak sebagian atau seluruh karya tulis ini dalam bentuk apapun tanpa izin UIN Suska Riau.

X_3	: Tingkat Suku Bunga
X_4	: Inflasi
e	: Error

3.4.3 Pengujian Hipotesis

Uji hipotesis digunakan untuk menguji hipotesis yang dilakukan oleh peneliti dengan cara menganalisis data yang telah diinput dan ditabulasikan. Adapun uji hipotesis dalam penelitian ini meliputi :

3.4.3.1 Uji Parsial (Uji T)

Tujuan pengujian ini adalah untuk mengetahui apakah masing – masing variabel independen berpengaruh secara signifikan terhadap variabel dependen. Pengambilan keputusan dilakukan berdasarkan perbandingan nilai T_{hitung} masing – masing koefisien dengan T_{tabel} , dengan tingkat signifikan 5%. Jika $T_{hitung} < T_{tabel}$ maka H_0 diterima, ini berarti variabel independen tidak berpengaruh terhadap nilai variabel dependen. Sedangkan jika $T_{hitung} > T_{tabel}$ maka H_0 ditolak dan menerima H_a , ini berarti variabel independen berpengaruh terhadap variabel dependen.

3.4.3.2 Uji Simultan (Uji F)

Uji F digunakan untuk mengetahui apakah seluruh variabel bebas (independen) secara bersama – sama berpengaruh terhadap variabel terikat (dependen) pada tingkat signifikan 0,05 (5%). Pengujian semua koefisien regresi secara bersama – sama dilakukan dengan uji F dengan pengujian, yaitu :

Hak Cipta Diindungi Undang-Undang

1. Dilarang mengutip sebagian atau seluruh karya tulis ini tanpa mencantumkan dan menyebutkan sumber:

- a. Pengutipan hanya untuk kepentingan pendidikan, penelitian, penulisan karya ilmiah, penyusunan laporan, penulisan kritik atau tinjauan suatu masalah.
- b. Pengutipan tidak merugikan kepentingan yang wajar UIN Suska Riau.

2. Dilarang mengumumkan dan memperbanyak sebagian atau seluruh karya tulis ini dalam bentuk apapun tanpa izin UIN Suska Riau.

Hipotesis : $H_0 : \beta_i = 0$ artinya secara bersama – sama tidak ada pengaruh signifikan antara variabel bebas terhadap variabel terikat.

$H_1 : \beta_i \neq 0$ artinya secara bersama – sama ada pengaruh signifikan antara variabel bebas terhadap variabel terikat.

Bila probabilitas $> \alpha$ 5% maka variabel bebas tidak signifikan atau tidak mempunyai pengaruh terhadap variabel terikat.

Bila probabilitas $< \alpha$ 5% maka variabel bebas signifikan atau mempunyai pengaruh terhadap variabel terikat.

3.4.3.3 Analisis Koefisien Determinasi (R^2)

Menurut Gujarati (2011:45) Koefisien determinasi (R^2) digunakan untuk mengukur seberapa jauh kemampuan model dalam menerangkan variasi variabel dependen. Nilai koefisien determinasinya berada diantara 0 dan 1. Nilai R^2 yang kecil berarti kemampuan variabel – variabel independen dalam menjelaskan variabel dependen sangat terbatas, sedangkan nilai yang mendekati satu berarti variabel – variabel independen memberikan hampir semua informasi yang dibutuhkan untuk memprediksi variabel dependen.