



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 Objek Penelitian

Objek penelitian ini terdiri dari dua macam variabel, yaitu variabel terikat (*dependent variabel*) atau variabel yang tergantung pada variabel lainnya, serta variabel bebas (*independent variabel*) atau variabel yang tidak tergantung pada variabel yang lainnya. Variabel yang digunakan dalam penelitian ini adalah harga saham pada sektor perbankan sebagai variabel terikat (variabel dependen) dan variabel bebas yaitu suku bunga SBI dan volume perdagangan saham.

#### 3.2 Jenis dan sumber data

##### 3.2.1 Jenis data

Jenis data yang digunakan dalam penelitian ini adalah data kuantitatif dan data kualitatif, data kuantitatif adalah data yang digunakan untuk meneliti pada populasi dan sampel tertentu, teknik pengambilan sampel pada umumnya dilakukan secara random, pengumpulan data menggunakan instrument penelitian, analisis data bersifat kuantitatif/statistik dengan tujuan untuk menguji hipotesis yang telah ditetapkan. Data kualitatif adalah data yang digunakan untuk meneliti pada kondisi obyek yang alamiah, analisis data bersifat induktif/kualitatif dan hasil penelitian kualitatif lebih menekankan makna dari pada generalisasi.

(Sugiyono; 2012; 13)

##### 3.2.2 Sumber data

Sumber data dalam penelitian ini menggunakan data sekunder. Menurut (Sugiyono; 2012; 402) Data sekunder adalah sumber yang tidak langsung



memberikan data kepada pengumpul data, misalnya lewat orang lain atau lewat dokumen. Data sekunder meliputi tingkat suku bunga Sertifikat Bank Indonesia (SBI), yang diperoleh dari laporan bulanan bank Indonesia (<http://www.bi.go.id>). Sedangkan harga saham dan volume perdagangan saham diperoleh melalui penelusuran di website Indonesia *Stock Exchange* (IDX) atau [www.idx.co.id](http://www.idx.co.id).

### 3.3 Metode pengumpulan data

Metode pengumpulan data pada penelitian ini adalah dengan mendokumentasikan yaitu dengan mencatat data-data objek penelitian di Bursa Efek Indonesia (BEI) melalui website pasar modal [www.idx.co.id](http://www.idx.co.id) serta data bank indonesia yang ditelusuri dengan website bank Indonesia [www.bi.go.id](http://www.bi.go.id).

### 3.4 Populasi dan sampel

Menurut (Sugiyono;2012;115) Populasi adalah wilayah generalisasi yang terdiri atas obyek/subyek yang mempunyai kualitas dan karakteristik tertentu yang ditetapkan oleh peneliti untuk dipelajari dan kemudian ditarik kesimpulannya.. Berdasarkan kualitas dan ciri tersebut, populasi dapat dipahami sebagai sekelompok individu atau objek pengamatan yang minimal memiliki satu persamaan karakteristik. Tujuan diadakan populasi adalah agar kita dapat menentukan besarnya anggota sampel yang diambil dari anggota populasi dan membatasi berlakunya daerah generalisasi. Populasi penelitian ini meliputi seluruh perusahaan perbankan yang terdaftar dibursa efek Indonesia dari periode 2010-2014.

Sedangkan sampel merupakan bagian dari jumlah dan karakteristik yang dimiliki oleh populasi tersebut. Karena tidak semua data dan informasi akan



### 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.

diproses dan tidak semua orang atau benda yang akan diteliti melainkan cukup dengan menggunakan sampel yang mewakilinya.

### 3.5 Metode Pengambilan Sampel

Dari populasi yang sudah ditentukan pemilihan sampel diambil dengan menggunakan metode *Purposive Sampling*. Menurut (Sugiyono; 2012; 122) metode *purposive sampling* merupakan teknik pengambilan sampel dengan pertimbangan tertentu.

kriteria yang digunakan dalam penelitian adalah:

1. Perusahaan perbankan yang masih terdaftar di Bursa Efek Indonesia (BEI) sampai tahun 2014.
2. Perusahaan Perbankan yang memiliki laporan harga saham dan laporan keuangan yang lengkap dan jelas yang telah dipublikasi untuk periode 2010 sampai 2014.
3. Perusahaan-perusahaan Perbankan tersebut memiliki data yang lengkap.
4. Perusahaan perbankan tersebut masuk dalam hitungan indeks LQ 45 di bursa efek Indonesia tahun 2014.

Jumlah keseluruhan bank *go public* yang terdaftar di BEI sampai tahun 2014 adalah sebanyak 36 Bank, tetapi yang memenuhi kareteria diatas hanya 6 bank. Sedangkan 30 Bank tidak memenuhi Kareteria diatas.

Adapun perusahaan yang menjadi sampel dalam penelitian ini sebagai berikut:

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.

**Tabel 3.1 N**  
**ama-nama Sampel Penelitian**

No.	Nama-nama Perusahaan Perbankan	Kode
1.	PT. Bank Central Asia, Tbk	BBCA
2.	PT. Bank Negara Indonesia (persero), Tbk	BBNI
3.	PT. Bank Rakyat Indonesia (Persero), Tbk	BBRI
4.	PT. Bank Danamon, Tbk	BDMN
5.	PT. Bank Mandiri (Persero), Tbk	BMRI
6.	PT. Bank Tabungan Pensiunan Nasional, Tbk	BTPN

Sumber: [www.idx.co.id](http://www.idx.co.id)

### 3.6 Metode Analisis Data

Untuk menganalisis data ini, penulis menggunakan metode analisis data kuantitatif. Analisis kuantitatif yang digunakan dalam penelitian ini untuk menjelaskan hubungan fungsional antara variabel independen suku bunga SBI dan volume perdagangan saham dengan variabel dependen yaitu harga saham.

#### 3.6.2 Uji Normalitas Data

Uji normalitas digunakan untuk menguji apakah nilai residual yang telah distandarisasi pada model regresi berdistribusi normal atau tidak. Dalam penelitian ini menggunakan uji normalitas dengan analisis grafik yaitu dengan menggunakan histogram dengan menggambarkan variabel dependent sebagai sumbu vertikal sedangkan nilai residual terstandarisasi digambarkan sebagai sumbu horizontal. Jika *Histogram Standardized Regression Residual* membentuk kurva seperti lonceng maka nilai residual tersebut dinyatakan normal.

Cara lain untuk menguji normalitas dengan pendekatan grafik adalah dengan menggunakan *Normal Probability Plot*, yaitu dengan membandingkan distribusi kumulatif dari data sesungguhnya dengan distribusi kumulatif dari distribusi normal. Selain itu ada juga uji normalitas dengan uji statistik non-



#### 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.

parametrik Kolmogorov-Smirnov merupakan uji normalitas menggunakan fungsi distribusi komulatif. (Suliyanto; 2011; 69)

### 3.6.3 Uji Asumsi Klasik

Uji asumsi klasik merupakan persyaratan statistik yang harus dipenuhi pada analisis regresi linear berganda yang berbasis *Ordinary Least Square* (OLS). Uji asumsi klasik yang sering digunakan yaitu uji normalitas data, uji multikolinearitas, uji heteroskedastisitas, uji autokorelasi dan uji linearitas. (Suliyanto; 2011; 69)

#### 3.6.3.1 Uji Multikolinearitas

Uji multikolinearitas bertujuan untuk menguji apakah dalam model regresi yang terbentuk ada korelasi yang tinggi atau sempurna diantara variabel bebas atau tidak. Jika dalam model regresi yang terbentuk terdapat korelasi yang tinggi atau sempurna diantara variabel bebas maka model regresi tersebut dinyatakan mengandung gejala multikolinier. Penelitian ini menggunakan uji multikolinearitas dengan TOL (*Tolerance*) dan *Variance Inflation Factor* (VIF). Jika nilai VIF tidak lebih dari 10, maka model dinyatakan tidak terdapat gejala multikolinier yang pengolahan datanya menggunakan SPSS.

#### 3.6.3.2 Uji Autokorelasi

Bertujuan untuk mengetahui apakah ada korelasi antara anggota serangkaian data observasi yang diuraikan menurut waktu (*times-series*) atau ruang (*cross section*). Penelitian ini menggunakan uji otokorelasi dengan metode Durbin Watson (*Durbin Watson Test*) yang merupakan uji yang sangat populer

Hak Cipta Diindungi Undang-Undang

1. Diarangi 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.

untuk menguji ada tidaknya masalah autokorelasi dari model empiris yang diestimasi.

$$DW = \frac{\sum_{t=2}^n (e_t - e_{t-1})^2}{\sum_{t=1}^n e_t^2}$$

Dimana:

$e_t$  : kesalahan gangguan dari sampel

$e_{t-1}$  : kesalahan gangguan dari sampel satu periode sebelumnya

Ketentuan :

Angka D-W dibawah -2 berarti ada autokorelasi positif.

Angka D-W dibawah -2 sampai +2 berarti tidak ada autokorelasi.

Angka D-W diatas +2 berarti ada autokorelasi negatif.

### 3.6.3.3 Uji Heteroskedastisitas

Uji 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. Yang diharapkan pada model regresi adalah yang homoskedastisitas. Dalam penelitian ini menggunakan uji heterokedastisitas dengan metode analisis grafik.

### 3.6.4 Analisis Regresi Linear Berganda

Untuk melihat pengaruh suku bunga Sertifikat Bank Indoneia (SBI) dan volume perdagangan saham terhadap harga saham, penulis menggunakan program SPSS 17.0 For windows, dimana dalam menganalisa data yang diperoleh dari

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.

objek penelitian penulis menggunakan analisis secara kuantitatif dengan menggunakan rumus regresi linier berganda dapat dituliskan sebagai berikut:

$$Y = a + b_1X_1 + b_2X_2 +$$

Dimana:

- Y : Harga Saham
- a : Intercept (Konstanta)
- b<sub>i</sub> : Koefesien regresi (i = 1,2)
- X<sub>1</sub> : Suku Bunga Sertifikat Bank Indoneia (SBI)
- X<sub>2</sub> : Volume Perdagangan Saham
- : Nilai residu (Error)

### 3.6.5 Uji t

Selanjutnya untuk mengetahui pengaruh masing-masing variabel bebas terhadap variabel terikat secara individual (parsial), maka dilakukan uji f untuk membandingkan t hitung dengan t tabel dengan derajat bebas: df: , (n-k) atau 0,05 dan ketentuan sebagai berikut:

1) t hitung > t tabel, Maka terdapat pengaruh antara suku bunga Sertifikat Bank Indoneia (SBI) dan volume perdagangan saham secara parsial terhadap harga saham pada Perusahaan sektor Perbankan di Bursa Efek Indonesia (BEI) periode 2010-2014.

2) t hitung < t tabel, Maka tidak terdapat pengaruh antara suku bunga Sertifikat Bank Indoneia (SBI) dan volume perdagangan saham secara parsial terhadap harga saham pada Perusahaan Perbankan di Bursa Efek Indonesia (BEI) periode 2010-2014.



#### Hak Cipta Diindungi Undang-Undang

### 3.6.6 Uji F

Digunakan untuk mengetahui pengaruh variabel bebas secara bersama (simultan) terhadap variable terikat, maka dilakukan uji F dengan membandingkan antara F hitung dengan F tabel dengan derajat bebas: df: , (k-1), (n-k) atau 0,05 atau ketentuan sebagai berikut :

1. Apabila  $F_{hitung} > F_{tabel}$  maka suku bunga SBI dan volume perdagangan saham mempunyai pengaruh secara simultan terhadap harga saham pada perusahaan sektor perbankan yang yang terdaftar di Bursa Efek Indonesia N (BEI) periode 2010-2014.
2. Apabila  $F_{hitung} < F_{tabel}$  maka suku bunga Sertifikat Bank Indoneia (SBI) dan volume perdagangan saham tidak mempunyai pengaruh secara simultan terhadap harga saham pada perusahaan sektor perbankan yang yang terdaftar di Bursa Efek Indonesia (BEI) periode 2010-2014.

### 3.6.7 Koefisien Determinasi ( $R^2$ )

Uji koefisien determinasi ( $R^2$ ) merupakan besarnya kontribusi variabel bebas terhadap variabel tergantungnya. Semakin tinggi koefisien determinasi, semakin tinggi kemampuan variabel bebas dalam menjelaskan variasi perubahan pada variabel tergantungnya.

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.



Untuk mengetahui besarnya kontribusi variabel  $X_1$  dan  $X_2$  terhadap variabel  $Y$  digunakan uji koefisien determinasi berganda ( $R^2$ ). Nilai  $R^2$  ini mempunyai range 0 (nol) sampai 1 ( $0 \leq R^2 \leq 1$ ). Semakin besar nilai  $R^2$  maka semakin baik hasil regresi tersebut dan semakin besar mendekati 0 (nol) maka variabel secara keseluruhan tidak bisa menjelaskan variabel terikat.

**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 mengummumkan dan memperbanyak sebagian atau seluruh karya tulis ini dalam bentuk apapun tanpa izin UIN Suska Riau.