

## DAFTAR PUSTAKA

- Afiyati, H. T. (2019). Pengaruh Inflasi, BI rate, dan Nilai Tukar terhadap *Return Saham*. *Jurnal Administrasi Bisnis (JAB)*, 61(2), 6.
- Bodie, Zvi, Alex Kane, Alan J. Marcus. 2014. Manajemen Portofolio dan Investasi. Bank Indonesia. 2023. Data Inflasi. [www.bi.go.id/id/moneter/inflasi](http://www.bi.go.id/id/moneter/inflasi) (diakses tanggal 29 Juli 2023).
- Bank Indonesia. 2023. Data Nilai Tukar. <https://www.bi.go.id/id/statistik/informasi-kurs/transaksi-bi/Default.aspx> (diakses tanggal 29 Juli 2023).
- Badan Pusat Statistik. 2023. Data Inflasi. <https://Www.Bps.Go.Id/Subject/3/Inflasi>. (diakses tanggal 29 Juli 2023).
- Badan Pusat Statistik. 2023. Data BI Rate. <https://www.bps.go.id/id/statistics-table/2/Mzc5IzI=/bi-rate.html>. (diakses tanggal 29 Juli 2023).
- Fitri, T. (2018). PENGARUH PROFITABILITAS TERHADAP HARGA SAHAM PADA PT BANK NEGARA INDONESIA (PERSERO) Tbk (Studi Kasus di Bursa Efek Indonesia Tahun 2013-2017): Manajemen Keuangan. *Ekonomedia*, 7(01), 72-80.
- Gujarati, D.N. & Porter, D.C. 2015. Dasar- Dasar Ekonometrika Buku I Edisi 5. Jakarta : Salemba Empat.
- Ghozali, I. 2011. Aplikasi Analisis Multivariate dengan Program IBM SPSS 19 (Edisi Kelima). Semarang : Universitas Diponegoro.
- Halim, Abdul. 2015. Analisis Kelayakan Investasi Bisnis. Yogyakarta: Graha Ilmu.
- Huda, Nurul.dkk. 2008. Ekonomi Makro Islam : Pendekatan Teoretis. Prenada Media Group. Jakarta.
- Harsono. 2018. "Pengaruh Inflasi, Suku Bunga, dan Nilai Tukar terhadap Indeks Harga Saham Gabungan".
- Hanum, H. 2011. Perbandingan Metode *Stepwise*, Best Subset Regression, dan Fraksi dalam Pemilihan Model Regresi Berganda Terbaik. Jurusan Matematika, F.MIPA, Universitas Sriwijaya.
- Hartono, Jugiyanto. 2014. Teori Portofolio dan Analisis Investasi. Yogyakarta : BPFE - Yogyakarta

- Karim, Adiwarmarman A. 2006. *Ekonomi Makro Islam*. PT. Rajagrafindo Persada. Jakarta.
- Kasmir. 2010. *Manajemen Perbankan*. Jakarta : Rajawali Pers.
- Kumulasari. 2016. “Pengaruh Nilai Tukar, BI *Rate*, Tingkat Inflasi, dan Pertumbuhan Ekonomi terhadap Indeks Harga Saham Gabungan” (Studi pada Bursa Efek Indonesia Periode Juli 2005 – Juni 2015).
- Mishkin, F.S. 2011. *Ekonomi Uang, Perbankan, dan Pasar Keuangan*. Buku 2. Edisi Delapan. Jakarta : Salemba Empat.
- Ningsih, M. M., & Waspada, I. (2018). Pengaruh BI Rate dan Inflasi terhadap Indeks Harga Saham Gabungan. *Jurnal Manajerial*, 3(5), 239-245.
- Natsir. 2014. *Ekonomi Moneter dan Kebanksentralan*. Jakarta : Mitra Wacana Media.
- Rinaldi M, Prayudyanto M N, Syaiful (2021). Persepsi Masyarakat Terhadap Tingkat Kepuasan Pelayanan Bus Transjabodetabek Dengan Metode Uji Asumsi Klasik Dan Uji Regresi Linear Berganda. Seminar Nasional Ketekniksipilan, Infrastruktur Dan Industri Jasa Konstruksi (Kijjk) 2021. Vol.1 No.1 (2021)
- Setyaningrum, Rani dan Muljono. 2016. Inflasi, Tingkat Suku Bunga Dan Nilai Tukar Terhadap *Return* Saham. *Jurnal Bisnis & Ekonomi*, 14(2): 151-161.
- Susanto, S., & Siddik, G. P. (2022). PENGARUH TOTAL ASSET TURNOVER DAN EARNING PER SHARE TERHADAP HARGA SAHAM. *Jurnal Investasi*, 8(4).
- Suhendar, I. A. (2021). ANALISIS PENGARUH PROFITABILITAS TERHADAP HARGA SAHAM PADA SEKTOR USAHA PERBANKAN DI BURSA EFEK INDONESIA. *Jurnal Perspektif Manajerial Dan Kewirausahaan (JPMK)*, 1(2), 164–174.
- Setiawan dan Kusri. 2010. *Ekonometrika* : Yogyakarta.
- Wanto, P. D., & Wibowo, W. 2018. ANALISIS FAKTOR YANG MEMPENGARUHI PDRB KABUPATEN BANGKALAN MENGGUNAKAN REGRESI LINIER BERGANDA.

- Wohon, S. C., Hatidja, D., & Nainggolan, N. (2017). Penentuan model regresi terbaik dengan menggunakan metode *stepwise* (Studi Kasus: Impor beras di Sulawesi Utara). *Jurnal Ilmiah Sains*, 17(2), 80-88.
- Wismantara, Yoga. 2017. Pengaruh Nilai Tukar, Suku Bunga dan Inflasi Terhadap Indeks Harga Saham Gabungan Di Bursa Efek Indonesia. Skripsi Jurusan Manajemen pada Fakultas Ekonomi dan Bisnis Universitas Udayana, Denpasar.

## LAMPIRAN

### Lampiran 1 Data Penelitian

No.	Month/Year	Return Saham	Inflasi (%)	BI Rate (%)	Nilai (Rupiah)	Tukar
1	Des-22	0,07317	5,51	5,5	15615,00	
2	Nov-22	-0,05051	5,42	5,25	15658,73	
3	Okt-22	-0,04521	5,71	4,75	15417,48	
4	Sep-22	-0,05014	5,95	4,25	14971,77	
5	Agu-22	-0,07918	4,69	3,75	14850,64	
6	Jul-22	0,00000	4,94	3,5	14984,38	
7	Jun-22	0,16879	4,35	3,5	14688,57	
8	Mei-22	0,00545	3,55	3,5	14608,00	
9	Apr-22	-0,10569	3,47	3,5	14368,74	
10	Mar-22	-0,03030	2,64	3,5	14348,64	
11	Feb-22	-0,08438	2,06	3,5	14348,64	
12	Jan-22	-0,07850	2,18	3,5	14335,24	
13	Des-21	0,00741	1,87	3,5	14328,92	
14	Nov-21	0,02941	1,75	3,5	14263,50	
15	Okt-21	-0,23214	1,66	3,5	14198,45	
16	Sep-21	0,00465	1,6	3,5	14256,96	
17	Agu-21	-0,11481	1,59	3,5	14397,70	
18	Jul-21	-0,03138	1,52	3,5	14511,19	
19	Jun-21	0,16631	1,33	3,5	14338,23	
20	Mei-21	0,05556	1,68	3,5	14323,19	

21	Apr-21	0,00439	1,42	3,5	14558,18
22	Mar-21	0,03930	1,37	3,5	14417,39
23	Feb-21	-0,06723	1,38	3,5	14042,10
24	Jan-21	0,11261	1,55	3,75	14061,90
25	Des-20	-0,02834	1,68	3,75	14173,09
26	Nov-20	-0,21000	1,59	3,75	14236,81
27	Okt-20	-0,06329	1,44	0,04	14749,14
28	Sep-20	0,14865	1,42	0,04	14847,96
29	Agu-20	-0,09804	1,32	0,04	14724,50
30	Jul-20	-0,00435	1,54	0,04	14582,41
31	Jun-20	-0,16376	1,96	4,25	14195,96
32	Mei-20	0,07050	2,19	4,25	14906,19
33	Apr-20	-0,06829	2,67	4,25	15867,43
34	Mar-20	0,83901	2,96	4,25	15194,57
35	Feb-20	0,02491	2,98	4,25	13776,15
36	Jan-20	0,09028	2,68	0,05	13732,23
37	Des-19	-0,04459	2,72	0,05	14017,45
38	Nov-19	0,02333	3	0,05	14068,72
39	Okt-19	-0,04235	3,13	0,05	14117,57
40	Sep-19	0,04762	3,39	5,25	14111,10
41	Agu-19	0,10065	3,49	5,5	14242,05
42	Jul-19	0,08555	3,32	5,75	14043,91
43	Jun-19	-0,08696	3,28	0,06	14226,53
44	Mei-19	0,14286	3,32	0,06	14392,81

45	Apr-19	-0,02083	2,83	0,06	14142,58
46	Mar-19	-0,06383	2,48	0,06	14211,00
47	Feb-19	0,03125	257	0,06	14035,21
48	Jan-19	-0,03030	2,82	0,06	14163,14
49	Des-18	-0,03409	3,13	0,06	14496,95
50	Nov-18	-0,13824	3,23	0,06	14696,86
51	Okt-18	0,01024	3,16	5,75	15178,87
52	Sep-18	0,05405	2,88	5,75	14868,74
53	Agu-18	-0,05128	3,2	5,5	14559,86
54	Jul-18	-0,04730	3,18	5,25	14414,50
55	Jun-18	0,20213	3,12	5,25	14036,14
56	Mei-18	-0,05015	3,23	4,75	14059,70
57	Apr-18	0,07764	3,41	4,25	13802,95
58	Mar-18	0,12104	3,4	4,25	13758,29
59	Feb-18	-0,03342	3,18	4,25	13590,05
60	Jan-18	0,05319	3,25	4,25	13380,36
61	Des-17	-0,18182	3,61	4,25	13556,21
62	Nov-17	-0,06173	3,3	4,25	13527,36
63	Okt-17	-0,02632	3,58	4,25	13526,00
64	Sep-17	-0,00676	3,72	4,25	13303,47
65	Agu-17	0,01361	3,82	4,5	13341,82
66	Jul-17	-0,11409	3,88	4,75	13342,10
67	Jun-17	-0,00758	4,37	4,75	13298,25
68	Mei-17	-0,02672	4,33	4,75	13323,35

69	Apr-17	0,01569	4,17	4,75	13306,39
70	Mar-17	-0,03475	3,61	4,75	13345,50
71	Feb-17	-0,08800	3,83	4,75	13340,84
72	Jan-17	-1,00000	3,49	4,75	13358,71

### Lampiran 2 Hasil Uji Heteroskedastis

Model		Unstandardized Coefficients		Standardized	t	Sig.
		B	Std. Error	Coefficients		
1	(Constant)	-,034	,410		-,083	,934
	Inflasi	,000	,001	-,050	-,410	,683
	Tingkat_suku_bunga	,010	,009	,136	1,110	,271
	Nilai Tukar	0,000007	,000	,029	,241	,810

a. Dependent Variable: RES2

### Lampiran 3 Hasil Uji Normalitas

		Unstandardized Residual
N		72
Asymp. Sig. (2-tailed)		0,200

### Lampiran 4 Hasil Uji Multikolinearitas

Variabel	Collinearity Statistics		Keputusan
	Tolerance	VIF	
Inflasi	0,959	1,043	<b>H<sub>0</sub> Diterima.</b>
BI Rate	0,957	1,045	
Nilai Tukar	0,993	1,007	

### Lampiran 5 Hasil Analisis *Stepwise Regression*

Model	Variabel Entered	Variabels Removed	Method
1	X3		Forward (Criteria:Probability of F to enter $\leq$ ,050)

Model		Beta In	Sig.
1	$X_1$	0,039	0,737
	$X_2$	0,017	0,884

Unstandardized Coefficients			
Model		B	Standard Error
1	(Constant)	-0,995	0,490
	$X_3$	0,000069	0,000

Model	Variabel Entered	Variabels Removed	Method
1	$X_3, X_1, X_2^b$		Enter
2		$X_2$	Backward (Criteria:Probability of F to remove $\geq$ ,100).
3		$X_1$	Backward (Criterion : Probability of F to remove $\geq$ ,100).

Unstandardized Coefficients			
Model		B	Standard Error
1	(Constant)	-1,019	0,530
	$X_1$	0,000	0,001
	$X_2$	0,002	0,011
	$X_3$	0,000070	0,000
2	(Constant)	-1,003	0,494
	$X_1$	0,000	0,001
	$X_3$	0,000069	0,000
3	(Constant)	-0,995	0,490
	$X_3$	0,000069	0,000



### Lampiran 6 Hasil Uji t

Model		Unstandardized Coefficients		Standardized Coefficients		Sig.
		B	Std. Error	Beta	t	
1	(Constant)	-1,019424	0,502665		-2,028038	0,046
	Inflasi	0,000264	0,000711	0,044644	0,371124	0,712
	BI Rate	0,002453	0,011335	0,026058	0,216393	0,829
	Nilai Tukar	0,000070	0,000035	0,236490	2,000798	0,049

a. Dependent Variable: Return Saham

### Lampiran 7 Hasil Uji f

Model		Sum of Squares	df	Mean Square	F	Sig.
1	Regression	0,126	3	0,042	1,357	0,263
	Residual	2,097	68	0,031		
	Total	2,223	71			

a. Dependent Variable: Return Saham

b. Predictors: (Constant), Inflasi, BI Rate, Nilai Tukar

### Lampiran 8 Hasil Koefisien Determinasi ( $R^2$ )

Model	R	R Square	Adjusted R-Square
1	.238 <sup>a</sup>	.056	.015
2	.236 <sup>b</sup>	.056	.028
3	.233 <sup>c</sup>	.054	.041