

BAB III

METODELOGI PENELITIAN

A. Tempat Dan Waktu Penelitian

Penelitian ini dilakukan dengan pengambilan data melalui *website* Otoritas Jasa Keuangan (OJK) yaitu <http://www.ojk.go.id> dan *website* Bank Indonesia (BI) yaitu <http://www.bi.go.id>

Dengan penelitian berdasarkan pengamatan dari Mei 2012 sampai Mei 2017 untuk memperoleh data-data yang menunjukkan gambaran tentang pengaruh inflasi dan nilai tukar (Kurs) terhadap Indeks Saham Syariah (ISSI).

B. Jenis Dan Sumber Data

Data adalah bahan mentah yang perlu di olah sehingga menghasilkan informasi atau keterangan. Baik kuantitatif maupun kualitatif yang menunjukkan fakta atau segala sesuatu yang dapat diperoleh kebenarannya sehingga dapat digunakan sebagai dasar untuk menarik suatu kesimpulan. Syarat-syarat

data yang baik adalah data harus akurat, data harus relevan, dan data harus *up to date*.¹

Jenis data yang digunakan dalam penelitian ini merupakan data sekunder karena yaitu sumber yang tidak langsung memberikan data kepada pengumpulan data, melainkan melalui orang lain atau melalui dokumen.² Peneliti tidak mengumpulkan sendiri data yang diperoleh melainkan data yang telah dikumpulkan dan diolah melalui pihak lain, dalam hal ini adalah Bank Indonesia, Bursa Efek Indonesia, dan Otoritas Jasa Keuangan. Yaitu data Inflasi, Nilai tukar (Kurs) Tengah Dan Indeks Saham Syariah Indonesia (ISSI).

Nilai tukar (kurs) tengah adalah kurs antara kurs jual dan kurs beli. Kurs tengah dihitung berdasarkan jumlah kurs jual dan kurs beli dibagi dua.³

¹ Sofyan Siregar, *Metode Penelitian Kuantitatif*, (Jakarta: kencana, 2013), 16.

² Sugiyono, *Metode Penelitian Kuantitatif Kualitatif Dan R&D*, (Bandung: Alfabeta, 2014),137.

³ <http://klikpajak.id>. (diakses 6 november 2018).

C. Populasi Dan Sampel

1. populasi

Populasi adalah wilayah generalisasi yang terdiri atas obyek atau subyek yang mempunyai kuantitatis dan karakteristik tertentu yang ditetapkan oleh peneliti untuk dipelajari dan ditarik kesimpulannya. Populasi mencakup segala hal, termasuk benda-benda alam, dan bukan sekedar jumlah yang ada pada objek tetapi seluruh karakteristik/ sifat yang dimiliki oleh subjek atau objek penelitian, jadi populasi adalah sekelompok orang, kejadian, atau benda, yang dijadikan obyek penelitian.⁴ Populasi dalam penelitian ini adalah inflasi dan nilai tukar (kurs) tengah yang tersaji pada laporan kebijakan moneter Bank Indonesia dan harga saham ISSI diperoleh dari Bursa Efek Indonesia.⁵

⁴ Imam Suprayogi Dan Tobroni, *Metodologi Penelitian Sisial-Agama*, (Bandung: PT. Remaja Rosdayakarta, 2001), 191.

⁵Ditha Fitria Syari, Pengaruh Inflasi Dan Nilai Tukar Terhadap Saham, 46.

2. Sampel

sampel merupakan himpunan bagian (*sub-set*) dari sebuah populasi tertentu.⁶Oleh karena itu, penulis menggunakan metode *purposive sampling*, yaitu pengambilan sampel yang terbatas pada jenis orang tertentu yang dapat memberikan informasi yang diinginkan, entah karena mereka adalah satu-satunya yang memilikinya atau memenuhi beberapa kriteria yang ditentukan oleh peneliti. Sampel penelitian ini mengambil data inflasi, Nilai Tukar (kurs) tengah dan data ISSI pada periode Mei 2012- Mei 2017.⁷Adapun tujuan dari metode ini untuk mendapatkan sampel yang representatif dengan kriteria yang telah ditentukan.

D. Teknik Pengumpulan Data

Metode pengumpulan data adalah prosedur yang sistematis dan standar untuk memperoleh data yang diperlukan adalah dokumentasi, yang mana data dokumentasi

⁶Gusti Ngurah Agung, *Statistika*, (Jakarta,PT. Raja Grafindo Persada, 2003), 21.

⁷Uma Sekaran, *Metodologi Penelitian* (Jakarta: Salemba Empat, 2005), 158.

memuat apa dan kapan sesuatu terjadi atau transaksi, serta siapa saja yang terlibat dalam suatu kejadian.

Metode yang digunakan untuk mendapatkan data yang dibutuhkan dalam penelitian ini adalah metode dokumentasi, yaitu dengan melihat dan melakukan pencatatan data terhadap data pada Bank Indonesia, Bursa Efek Indonesia dan Otoritas Jasa Keuangan yang berupa data sekunder. Penelitian juga dilakukan dengan menggunakan studi kepustakaan, yaitu mempelajari, memahami, mencermati, menelaah, mengidentifikasi hal-hal yang sudah ada dan apa yang belum ada dalam bentuk jurnal-jurnal atau karya-karya ilmiah yang berkaitan dengan permasalahan penelitian.

E. Teknik Analisis Data

Metode analisis data adalah metode yang digunakan untuk mengolah dan memprediksi hasil penelitian guna memperoleh suatu kesimpulan.

1. Transformasi Data

Transformasi pada peubah respon ditengarai merupakan upaya perbaikan atas ketaknormalan dan

ketakhomogenan ragam pada model linier atau bilinear. Model linier atau bilinear dapat dikenakan pada data yang telah ditransformasi, dan sifat sebaran sisaan diasumsikan memenuhi sebaran normal. Transformasi data pada hakekatnya adalah suatu usaha untuk mengubah data dari suatu skala ke skala yang lain. Model linier yang klasik (analisis ragam atau regresi) telah dikembangkan berdasarkan beberapa asumsi pokok yaitu keaditifan (model pengaruh utama), ragam perlakuan yang homogeny (keragaman data bersifat bebas dari rata-rata dan banyaknya ulangan), dan ketaknormalan data.

Dalam hal ini, transformasi data bertujuan untuk mengatasi tiga masalah utama yaitu keheterogenan ragam, ketaknormalan galat, dan ketakaditifan atau ketaklinieran pengaruh sistematis.⁸

⁸ Alfian Futuhul Hadi, Dkk. "Penanganan Ketaknormalan Data Pada Model AMMI Dengan Transformasi Box-Cox", Vol.8 No 2, (2 Juli 2017), 167.

2. Uji Asumsi Klasik

Uji asumsi klasik dilakukan guna mengetahui apakah regresi dapat dilakukan atau tidak. Data dalam penelitian ini menggunakan data sekunder, sehingga adanya beberapa asumsi klasik yang akan digunakan. Model regresi linear berganda merupakan model yang baik apabila memenuhi kriteria *Best Linear Unbiased Estimator* (BLUE) dan untuk memenuhi kriteria tersebut dibutuhkan setidaknya empat langkah uji asumsi, yaitu:

a. Uji Normalitas

Uji normalitas bertujuan untuk menguji apakah dalam model regresi, variabel pengganggu atau residual memiliki distribusi normal.⁹ Pada prinsipnya normalitas dapat dideteksi dengan melihat penyebaran data (titik) pada sumbu diagonal dari grafik atau dengan melihat histogram dari residualnya.

⁹ Imam Ghozali, *Aplikasi Analisis Multivariate dengan Program IBM SPSS 19* (Semarang: BP UNDIP, 2011), 160.

b. Uji Autokorelasi

Uji autokorelasi bertujuan menguji apakah dalam suatu model regresi linear ada korelasi antara kesalahan pengganggu pada periode t dengan kesalahan periode $t-1$ (sebelumnya). Jika terjadi korelasi, maka dinamakan ada masalah autokorelasi. Model regresi yang baik adalah model regresi yang bebas dari autokorelasi.

c. Uji Multikolinearitas

Uji multikolinearitas bertujuan untuk mengetahui apakah dalam model regresi ditemukan korelasi antar variabel independen atau tidak. Model yang baik seharusnya tidak terjadi korelasi yang tinggi diantara variabel independen.

d. Uji Heteroskedastisitas

Uji heteroskedastisitas dilakukan dengan tujuan mengetahui apakah model regresi layak dipakai untuk memprediksi variabel terikat dipengaruhi oleh variabel bebas. Pada heteroskedastisitas kesalahan yang terjadi tidak

acak tetapi menunjukkan hubungan yang sistematis sesuai dengan besarnya satu atau lebih variabel. Apabila heteroskedastisitas tidak terpenuhi, maka variabel yang digunakan tidak lagi efisien dalam sampel yang digunakan dan estimasi koefisien menjadi tidak akurat.

3. Uji Analisis Regresi Berganda

Analisis regresi linear berganda bertujuan untuk mengetahui hubungan linear antara dua variabel atau lebih. Dimana satu variabel sebagai variabel dependen (terikat) dan yang lainnya sebagai variabel independen (bebas). Hasil analisis regresi adalah berupa koefisien regresi untuk masing-masing variabel independen. Koefisien ini diperoleh dengan cara memprediksi nilai variabel dependen dengan suatu persamaan. Dalam analisis regresi, selain mengukur kekuatan hubungan antara dua variabel atau lebih, juga menunjukkan arah hubungan antara variabel dependen dengan variabel independen.

4. Uji Hipotesis

a. Uji F (Simultan)

Uji F digunakan untuk mengetahui apakah variabel-variabel independen secara simultan berpengaruh signifikan terhadap variabel dependen. Derajat kepercayaan yang digunakan adalah 0,005. Apabila nilai F hitung lebih besar dari F tabel maka hipotesis alternatif yang menyatakan bahwa semua variabel independen secara simultan berpengaruh signifikan terhadap variabel dependen.

b. Uji t (Parsial)

Uji t pada dasarnya menunjukkan seberapa jauh pengaruh satu variabel independen secara individual menerangkan variasi variabel terikat. Pengujian ini dimaksudkan untuk mengetahui apakah variabel bebas secara individual mempunyai pengaruh terhadap variabel terikat dengan asumsi variabel yang lain itu konstan.

c. Koefisien Korelasi

Uji analisis koefisien korelasi menunjukkan kemampuan hubungan antara variabel independen dengan variabel dependen. Angka koefisien korelasi yang dihasilkan dalam uji ini berguna untuk menunjukkan kuat lemahnya hubungan antara variabel independen dengan variabel dependen.

d. Koefisien Determinasi

Koefisien determinasi bertujuan untuk mengukur seberapa jauh kemampuan model dalam menerangkan variasi variabel dependen. Dalam uji regresi linear berganda dianalisis pula besarnya koefisien regresi (R^2) keseluruhan. R^2 pada intinya mengukur seberapa jauh kemampuan model regresi dalam menerangkan variasi variabel dependen atau variabel terikat.¹⁰ Nilai R^2 yang kecil berarti kemampuan variabel-variabel independen dalam menjelaskan variasi variabel dependen amat terbatas. Nilai yang mendekati satu

¹⁰ Imam Ghozali, *Aplikasi Analisis Multivariate dengan Program IBM SPSS 19*, 97.

berarti variabel-variabel independen memberikan semua informasi yang dibutuhkan untuk memprediksi variasi variabel independen.

Selain R^2 untuk menguji determinasi variabel-variabel bebas (X) terhadap variabel-variabel terikat (Y) akan dilakukan dengan melihat koefisien korelasi parsial (r^2). Nilai r^2 yang paling tinggi akan menunjukkan tingkat hubungan dan pengaruh yang dominan terhadap variabel terikat.