

## **BAB III**

### **METODELOGI PENELITIAN**

#### **3.1 Desain Penelitian**

Metode penelitian mengungkapkan dengan jelas bagaimana cara memperoleh data yang diperlukan, oleh karena itu metode penelitian lebih menekankan pada strategi, proses dan pendekatan dalam memilih jenis, karakteristik serta dimensi ruang dan waktu dari data yang diperlukan. Jenis metode penelitian yang digunakan dalam penelitian ini adalah metode deskriptif verifikatif. Seperti dikemukakan oleh Moh Nazir (2003:54) bahwa :

Metode deskriptif adalah suatu metode dalam meneliti status sekelompok manusia, suatu objek, suatu set kondisi, suatu sistem pemikiran ataupun suatu kelas peristiwa pada masa sekarang. Tujuan dari penelitian deskriptif ini adalah untuk membuat deskripsi, gambaran atau lukisan secara sistematis, faktual dan akurat mengenai fakta-fakta, sifat-sifat serta hubungan antar fenomena yang diselidiki.

Metode verifikatif merupakan penelitian yang bertujuan untuk menguji kebenaran dari suatu hipotesis yang dilaksanakan melalui pengumpulan data di lapangan. Menurut Ety Rochaety (2007:13) ”metode verifikatif merupakan metode penelitian yang bertujuan untuk menguji hubungan-hubungan variabel dari hipotesis-hipotesis yang disertai data empiris”.

Selain menggunakan metode, dalam penelitian ini menggunakan pula desain penelitian menurut tingkat ekplanasinya (tingkat kejelasan) yang bermaksud menjelaskan kedudukan variabel-variabel yang diteliti serta hubungan antara satu variabel dengan variabel lain. Dalam penelitian ini, desain penelitian yang digunakan adalah desain kausal yang bersifat asimetris atau hubungan yang

terjadi akibat variabel bebas terhadap variabel tidak bebasnya, menurut Husein Umar (2009:35)

Desain kausal berguna untuk menganalisis hubungan-hubungan antara satu variabel dengan variabel lainnya atau bagaimana variabel satu mempengaruhi variabel lainnya. Sifat hubungan-hubungan yang mungkin terjadi diantara variabel-variabel ini ada tiga kemungkinan yaitu simetris, asimetris, dan timbal balik.

### 3.2 Definisi dan Operasionalisasi Variabel

Menurut Sugiyono (2005:32) variabel diartikan sebagai "Suatu atribut atau sifat atau nilai dari orang, obyek atau kegiatan yang mempunyai variasi tertentu yang ditetapkan oleh peneliti untuk dipelajari dan ditarik kesimpulannya"

Selanjutnya penjelasan mengenai variabel dikemukakan oleh Sugiyono (2005 : 4):

Variabel independen merupakan variabel yang mempengaruhi atau yang menjadi sebab perubahannya atau timbulnya variabel dependen. Sedangkan variabel dependen merupakan variabel yang dipengaruhi atau yang menjadi akibat, karena adanya variabel bebas.

Dalam penelitian ini terdapat dua variabel yang akan diteliti, adapun variabel tersebut di definisikan sebagai berikut :

a) Variabel terikat (dependen)

Indeks Harga Saham Gabungan (IHSG) dalam penelitian ini dijadikan sebagai variabel terikat, Indeks Harga Saham Gabungan (IHSG) merupakan indeks yang merangkum keseluruhan perkembangan harga-harga saham di BEI.

b) Variabel bebas (independen)

Yang menjadi variabel bebas dalam penelitian ini adalah indeks Nekkei 225, indeks Nikkei 225 adalah indeks bursa TSE *Tokyo Stock Exchange* yang terdiri dari 225 saham perusahaan ranking tertinggi di bursa .

Untuk melihat lebih jelas mengenai bagaimana operasional variabel maka berikut disajikan tabel dari operasional variabel:

**Table 3.1**  
**Tabel Operasionalisasi Variabel**

Variabel	Dimensi	Indikator	Skala
Indeks Nikkei 225 (X)	Nilai pada penutupan harian	<p>Hasil perhitungan:</p> $\frac{\text{Sum of Adjusted Stock Price}}{\text{Divisor}}$ <p>Ket:</p> <p>a) <i>Sum of Adjusted Stock Price</i> di peroleh dari penjumlah harga saham dikali dengan nilai dasar nominal dibagi perkiraan nilai nominal (<i>presumed par value</i>)</p> <p>b) <i>Divisor</i> merupakan nilai pembagi yang diperoleh dari otoritas bursa yang dapat diperoleh dari publikasi <i>Nihon Keizi Shibun</i></p>	Rasio
IHSG (Y)	Nilai pada penutupan harian	<p>Hasil perhitungan :</p> $\frac{\text{Nilai Pasar}}{\text{Nilai Dasar}}$ <p>Ket :</p> <p>a) Nilai Pasar adalah jumlah saham hari ini dikali harga pasar hari ini</p> <p>b) Nilai dasar adalah jumlah saham hari dasar dikali dengan harga saham hari dasar</p>	Rasio

### 3.3 Jenis dan Sumber Data

Jenis data yang digunakan pada penelitian ini adalah data yang bersifat kuantitatif, menurut Sugiono (2005:41) “data kuantitatif adalah data yang berbentuk angka, atau data kualitatif yang diangkakan.”

Menurut sumber pengambilannya, data yang digunakan dalam penelitian ini adalah data sekunder. Menurut Husein Umar (2009:42) “data sekunder merupakan data primer yang telah diolah lebih lanjut dan disajikan baik oleh pihak pengumpul data primer atau pihak lain misalnya dalam bentuk tabel-tabel.”

Pada penelitian ini, data yang digunakan merupakan data pergerakan penutupan harian indeks Nikkei 225 dan IHSG. Dalam penelitian ini data kedua indeks merupakan data historis sepanjang penutupan harian awal bulan Januari 2009 sampai akhir bulan Oktober 2011. Untuk data pergerakan IHSG dalam penelitian ini diambil dari penutupan tanggal 6 Januari 2009 sampai dengan 31 Desember 2011 sedangkan untuk Indeks Nikkei 225 data yang digunakan merupakan data penutupan harian sebelumnya dari data penutupan IHSG yang digunakan dalam penelitian ini. Hal tersebut dilakukan agar penelitian yang dilakukan dapat benar-benar menjelaskan bahwa pergerakan indeks Nikkei 225 akan memberikan dampak pada pergerakan IHSG. Dengan demikian jumlah data yang digunakan dari kedua data tersebut masing-masing sebanyak 692 data.

Rentang data tersebut diambil dikarenakan pada rentang tahun tersebut IHSG mengalami keguncangan dikarenakan krisis yang terjadi luar negeri baik berupa dampak krisis 2008 hingga krisis Eropa di tahun 2011.

### 3.4 Teknik Pengumpulan Data

Data sekunder berupa pergerakan IHSG diperoleh pusat informasi pasar modal Bursa Efek Indonesia yang tersedia website [www.idx.co.id](http://www.idx.co.id) sedangkan data sekunder indeks Nikkei 225 diperoleh dari website yang menyediakan layanan informasi pergerakan saham seluruh dunia website tersebut yaitu [www.finance.yahoo.com](http://www.finance.yahoo.com). Data diperoleh meliputi harga penutupan saham harian selama rentang penelitian. Sehingga, teknik pengumpulan data yang digunakan dalam penelitian ini adalah telaah dokumentasi melalui pengumpulan dokumen-dokumen pergerakan indeks saham yang diteliti.

### 3.5 Teknik Pengelolaan Data dan Uji Hipotesis

Desain penelitian kali ini menggunakan metode kausal dengan tipe asimetris oleh karena itu diperlukan analisis data yang tepat untuk menjawab permasalahan penelitian dan menguji hipotesis analisis yang dipilih adalah metode regresi linier sederhana. Menurut Iqbal hasan (2004:63) “regresi linier sederhana adalah regresi linier dimana sebuah variabel terikat (variabel Y) dihubungkan dengan satu variabel bebas (variabel X).”

#### 3.5.1 Uji Linearitas

Pengujian linieritas data dilakukan ketika analisis regresi akan digunakan untuk mengetahui bagaimana variabel X mempengaruhi Y. Sebagaimana dikemukakan Moh. Nazir (2003:458) bahwa “dalam analisis regresi, dipikirkan

bahwa hubungan antara variabel independen dan variabel dependen adalah dalam bentuk linier...”.

Uji linieritas garis regresi ini merupakan prasyarat apakah model garis regresi dapat digunakan untuk menganalisis data. Dalam perhitungan uji linieritas digunakan program *SPSS versi 17 For Windows*.

### 3.5.2 Analisis Regresi Linear Sederhana

“Regresi linier sederhana adalah regresi linier dimana variabel yang terlibat di dalamnya hanya dua, yaitu satu variabel terikat Y, dan satu variabel bebas X”(Iqbal Hasan 2004:63) Persamaan umum regresi sederhana adalah:

$$\hat{Y} = a + bX$$

(Sudjana, 2004:204)

Dari persamaan di atas, nilai a dan b dapat diketahui dengan menggunakan rumus sebagai berikut :

$$a = \frac{(\sum Y_i)(\sum X_i^2) - (\sum X_i)(\sum X_i Y_i)}{n\sum X_i^2 - (\sum X_i)^2}$$

$$b = \frac{n\sum X_i Y_i - (\sum X_i)(\sum Y_i)}{n\sum X_i^2 - (\sum X_i)^2}$$

(Sudjana, 2004:205)

Keterangan :

- $\hat{Y}$  = subjek variabel terikat yang diprediksi
- X = subjek variabel bebas yang mempunyai nilai tertentu
- a = bilangan konstanta (nilai Y pada saat X nol)
- b = angka arah atau koefisien regresi yang menunjukkan perubahan rata-rata variabel Y untuk setiap variabel X sebesar satu bagian.

Dalam perhitungan analisis regresi linearitas digunakan program pembantu berupa software *SPSS versi 17.0 For Windows*.

