

## **BAB III**

### **METODE PENELITIAN**

#### **3.1 Model Penelitian**

Model Penelitian yang di pakai adalah model penelitian kuantitatif. Dalam KBBI metode diartikan sebagai “cara teratur yang digunakan untuk melaksanakan suatu pekerjaan agar tercapai sesuai dengan yang dikehendaki; cara kerja yang bersistem untuk memudahkan pelaksanaan suatu kegiatan guna mencapai tujuan yang ditentukan”. Definisi ini menunjukkan bahwa metode itu suatu aktivitas yang sudah operasional, artinya metode sudah dapat dijadikan pedoman untuk melakukan kegiatan tertentu.

#### **3.2. Obyek Penelitian**

Obyek dalam penelitian adalah perusahaan kopi yang go public

#### **3.3. Populasi, Sampel dan Teknik Sampling**

Populasi merupakan semua yang menjadi subjek penelitian. Populasi dalam penelitian ini yaitu nilai komoditas perusahaan kopi dan valuta asing. Teknik pengambilan sampel yang digunakan dalam penelitian ini yaitu menggunakan teknik *Purposive Sampling*. Kriteria pengambilan sampel dalam penelitian ini yaitu diantaranya:

1. Perusahaan sudah Go public dan telah terdaftar di BEI (Bursa Efek Indonesia) selama tahun 2014 - 2019

2. Perusahaan memiliki Saham aktif pada periode pengamatan yaitu pada tahun 2014-2019
3. Perusahaan memiliki catatan harga saham yang lengkap selama periode penelitian yaitu tahun 2014-2019

**Tabel 3.1. Sampel Penelitian**

| No | Keterangan   | Total |
|----|--|-------|
| 1  | Perusahaan kopi Indonesia yang go public                                   | 6     |
| 2  | Perusahaan kopi Indonesia yang tidak terdaftar di BEI                      | 0     |
| 3  | Perusahaan yang tidak memiliki catatan harga saham selama tahun pengamatan | 0     |
| 4  | Sampel   | 6     |

Sumber : data yang di olah , 2019

### **3.4 Metode Pengumpulan Data**

#### **3.4.1. Jenis dan Sumber Data**

Jenis data yang digunakan dalam penelitian ini adalah data sekunder, yaitu data yang diperoleh peneliti secara tidak langsung dengan mempelajari dokumen yang berhubungan dengan penelitian yaitu laporan keuangan perusahaan. Sumber data yang diperoleh akan dilakukan dengan cara mengakses website [www.idx.co.id](http://www.idx.co.id), [finance.yahoo.com](http://finance.yahoo.com); [id.investing.com](http://id.investing.com); [bps.go.id](http://bps.go.id); dan [bi.go.id](http://bi.go.id),

#### **3.4.2. Teknik Pengumpulan Data**

Teknik pengumpulan data pada penelitian ini menggunakan metode non participant observation, dimana memanfaatkan dokumen-dokumen tertulis yang sudah ada seperti jurnal dari penelitian terdahulu, laporan harga saham, data statistik faktor makro ekonomi Indonesia , buku pedoman teori, data artikel yang tersebar di internet, dan data lain-lainnya dimana observasi dilakukan dengan hanya

melakukan pencatatan terhadap data yang sudah ada tersebut tanpa peneliti perlu terjun langsung dalam proses atau kegiatan yang ingin diamati sesuai dengan penelitiannya

### **3.5 Alat Analisis Data**

#### **3.5.1 Uji Asumsi Klasik**

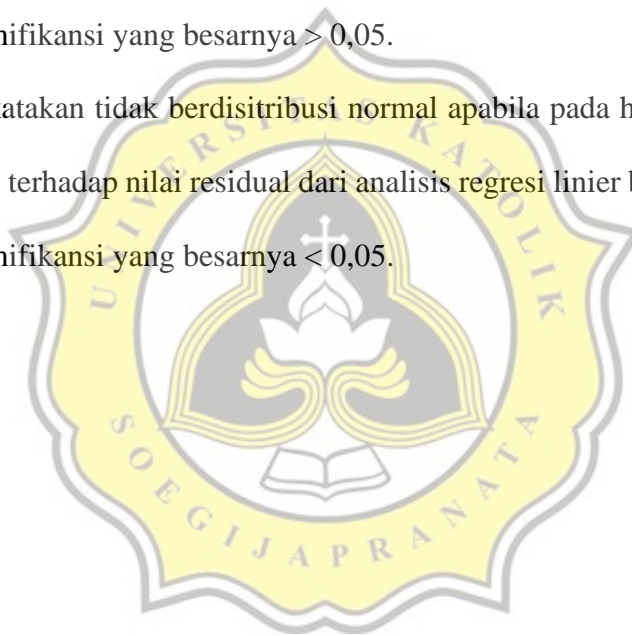
Tahapan pertama pelaksanaan analisis pada penelitian ini melalui uji asumsi klasik. Uji asumsi klasik ini merupakan uji prasyarat yang dilakukan sebelum melakukan analisis lebih lanjut terhadap data yang telah dikumpulkan. Pengujian asumsi klasik ini ditujukan agar dapat menghasilkan model regresi yang memenuhi kriteria BLUE (Best Linier Unbiased Estimator). Model regresi yang memenuhi kriteria BLUE dapat digunakan sebagai estimator yang terpercaya dan handal dimana estimator tersebut dinyatakan tidak bias, konsisten, berdistribusi normal dan juga efisien. Untuk mengetahui apakah model regresi yang akan digunakan telah memenuhi kriteria BLUE maka perlu dilakukan serangkaian pengujian yaitu Uji Normalitas, Uji Multikolinieritas, Uji Heteroskedastisitas, dan Uji Autokorelasi yang akan dibahas lebih lanjut satu per satu pada bagian selanjutnya.

#### **3.5.2. Uji Normalitas**

Uji normalitas dilakukan untuk dapat menguji apakah data yang akan digunakan untuk uji hipotesis yaitu data dari variabel dependen dan independen yang digunakan telah berdistribusi secara normal ataukah tidak. Untuk menguji apakah data berdistribusi normal atau tidak, dalam penelitian ini menggunakan uji dengan analisis statistik yaitu uji Kolmogrov-Smirnov. Pada pengujian Kolmogrov-

Smirnov ini. Data dikatakan memenuhi uji normalitas dan memenuhi kriteria dari BLUE (Best Linier Unbiased Estimator) apabila data dinyatakan berdistribusi dengan normal. Untuk mengetahui apakah data penelitian memiliki distribusi yang normal atau tidak melalui uji Kolmogrov-Smirnov yaitu berdasarkan asumsi berikut:

1. Data dikatakan berdistribusi normal apabila pada hasil uji Kolmogrov-Smirnov terhadap nilai residual dari analisis regresi linier berganda, dihasilkan nilai signifikansi yang besarnya  $> 0,05$ .
2. Data dikatakan tidak berdistribusi normal apabila pada hasil uji Kolmogrov-Smirnov terhadap nilai residual dari analisis regresi linier berganda, dihasilkan nilai signifikansi yang besarnya  $< 0,05$ .



### 3.5.3. Uji Multikolinieritas

Uji multikolinieritas ini ditujukan untuk mengetahui apakah masing-masing variabel bebasnya berhubungan secara linier atau saling berkorelasi. Model regresi dinyatakan memenuhi kriteria BLUE (Best Linier Unbiased Estimator) apabila tidak terdapat multikolinieritas. Multikolinieritas dapat diketahui melalui beberapa pengujian salah satunya yang digunakan dalam penelitian ini yaitu dengan menghitung nilai VIF dan Tolerance dari masing-masing variabel bebas. Untuk mengetahui apakah pada data penelitian mengandung multikolinieritas atau tidak, dapat didasarkan pada asumsi berikut:

1. Apabila nilai  $VIF > 10$  dan nilai  $Tolerance < 0.1$ , maka data dapat dikatakan mengandung multikolinieritas.
2. Apabila nilai  $VIF < 10$  dan nilai  $Tolerance > 0.1$ , maka data dapat dikatakan tidak mengandung multikolinieritas

### 3.5.4. Uji Heteroskedastisitas

Uji heteroskedastisitas ini dilakukan untuk dapat menguji apakah model regresi memiliki keragaman error yang sama atau tidak. Asumsi keragaman error yang sama ini disebut dengan homoskedastisitas, sedangkan heteroskedastisitas yaitu terjadi jika keragaman nilai errornya tidak konstan atau berbeda. Hendaknya untuk dapat memenuhi kriteria BLUE (Best Linear Unbiased Estimator), nilai error pada setiap pengamatan nilainya konstan. Apabila pada data setelah dilakukan pengujian dinyatakan mengandung heteroskedastisitas maka terjadi penyimpangan syarat asumsi klasik, dimana terdapat syarat dalam kriteria BLUE (Best Linier

Unbiased Estimator), model regresi harusnya tidak mengandung heteroskedastisitas. Heteroskedastisitas dapat dideteksi melalui beberapa pengujian salah satunya yaitu Uji Gletser dimana melakukan uji regresi variabel bebas pada nilai residual yang telah diabsolutkan. Nilai residual ini dihasilkan melalui analisis regresi linier berganda pada data penelitian. Untuk mengetahui apakah pada data mengandung heteroskedastisitas atau tidak, dapat didasarkan pada asumsi berikut:

1. Apabila dari hasil uji gletser ditemukan bahwa nilai signifikansi dari variabel independen terhadap nilai absolut residual  $<$  taraf signifikan yang ditentukan (0,05), maka data dapat dikatakan mengandung heteroskedastisitas .
2. Apabila dari hasil uji gletser ditemukan bahwa nilai signifikansi dari variabel independen terhadap nilai absolut residual  $>$  taraf signifikan yang ditentukan (0,05), maka data yang digunakan dalam penelitian dapat dikatakan tidak mengandung heteroskedastisitas .

### **3.5.5. Uji autokorelasi**

Uji autokorelasi dilakukan untuk dapat menguji model regresi yang akan digunakan, apakah terdapat korelasi antara error pada pengamatan satu dengan error pada pengamatan sebelumnya atau tidak. Apabila terjadi korelasi antarpengamatan dalam runtut waktu, maka dapat dikatakan ada problema autokorelasi. Data dinyatakan memenuhi kriteria BLUE (Best Linier Unbiased Estimator) apabila pada data dinyatakan tidak mengandung autokorelasi. Untuk mengetahui apakah dari data yang ada terdapat autokorelasi atau tidak, dapat menggunakan uji Runs

Test. Berdasarkan uji runs, data dikatakan mengandung autokorelasi atau tidak berdasarkan asumsi dibawah ini:

1. Apabila hasil uji runs menunjukkan bahwa nilai signifikansi  $<$  taraf signifikan yang ditetapkan (0.05), maka dapat dikatakan data penelitian mengandung autokorelasi.
2. Apabila hasil uji runs menunjukkan bahwa nilai signifikansi  $>$  taraf signifikan yang ditetapkan (0.05), maka dapat dikatakan data penelitian tidak mengandung autokorelasi.

### 3.5.6.Uji T

Untuk mengetahui apakah hipotesis yang diajukan dalam penelitian ini terpenuhi atau tidak, yaitu untuk mengetahui apakah pengaruh dari masing-masing variabel independen signifikan atau tidak maka dalam penelitian ini menggunakan uji T sebagai alat pengujianya. Uji T yaitu alat analisis regresi yang digunakan untuk menentukan pengaruh dari masing-masing variabel independen yang digunakan terhadap variabel dependen. Berdasarkan hasil output dari uji T, variabel independen dikatakan berpengaruh secara signifikan apabila nilai signifikansinya lebih kecil dari 0,05. Jadi dapat disimpulkan sebagai berikut,

1. Jika nilai signifikansi variabel  $i > 0,05$ , maka  $H_0$  ditolak , harga komoditas , valuta asing , inflasi secara parsial tidak berpengaruh
2. Jika nilai signifikansi variabel  $i < 0,05$ , maka  $H_0$  diterima, maka harga komoditas , valuta asing , inflasi secara parsial berpengaruh