

DAFTAR ISI

PERNYATAAN BEBAS DARI PLAGIAT	i
PERTANGGUNGJAWABAN SKRIPSI	ii
LEMBAR YURIDIS.....	Error! Bookmark not defined.
LEMBAR PERSETUJUAN SKRIPSI.....	iv
UCAPAN TERIMAKASIH.....	v
ABSTRAK	viii
RINGKASAN	ix
DAFTAR ISI.....	xiii
DAFTAR TABEL	xv
DAFTAR GAMBAR	xvi
DAFTAR LAMPIRAN.....	xvii
 BAB 1 PENDAHULUAN	 1
1.1 Latar Belakang.....	1
1.2 Rumusan Masalah	11
1.2.1 Pernyataan Masalah	11
1.2.2 Pertanyaan Penelitian	11
1.3 Tujuan Penelitian.....	11
1.4 Kontribusi Penelitian	12
1.4.1 Kontribusi Teoritis	12
1.4.2 Kontribusi Praktis	12
1.4.3 Kontribusi Agamis	12
 BAB II TINJAUAN PUSTAKA	 13
2.1 Landasan Teori	13
2.1.1 <i>Jakarta Islamic Index (JII)</i>	13
2.1.2 Pasar Modal.....	15
2.1.3 Investasi	16
2.1.4 Saham dan Harga Saham	18
2.1.5 Rasio Keuangan	22
2.1.6 Pengaruh <i>Debt to Equity Ratio</i> Terhadap Harga Saham.....	25

2.1.7	Pengaruh <i>Net Profit Margin</i> terhadap Harga Saham	26
2.1.8	Pengaruh <i>Retrun on Equity</i> terhadap Harga Saham	26
2.1.9	Pengaruh <i>Price Earning Ratio</i> terhadap Harga Saham	27
2.2	Kajian Empiris	27
2.3	Kerangka Konseptual dan Hipotesis	31
2.3.1	Kerangka Konseptual	31
2.3.2	Hipotesis Penelitian	31
BAB 3 METODE PENELITIAN		32
3.1	Bentuk Penelitian	32
3.2	Jenis dan Sumber Data	32
3.3	Variabel Penelitian	32
3.4	Metode Analisis Vector Autoregression (VAR)	34
3.5	Pemilihan Model <i>Vector Autoregresion</i> (VAR)	35
3.5.1	Uji Stasioneritas Data	35
3.5.2	Uji Panjang Lag Optimum	36
3.5.3	Uji Stabilitas Model VAR	36
3.5.4	Analisis Kausalitas Granger	36
3.5.5	Model Empiris VAR/VECM	36
3.5.6	Analisis IRF (Implus Response Function)	37
3.5.7	Analisis VDC (Variance Decomposition)	37
BAB IV HASIL PENELITIAN DAN PEMBAHASAN		38
4.1	Hasil Penelitian	38
4.1.1	Hasil pengujian Model <i>Vector Autoregressive</i>	38
4.2	Pembahasan Hasil Penelitian	49
4.2.1	Pengaruh <i>Debt to Equity</i> terhadap Harga Saham	49
4.2.2	Pengaruh <i>Net Profit Margin</i> terhadap Harga Saham	50
4.2.3	Pengaruh <i>Retrun on Equity</i> Terhadap Harga Saham	52
4.2.4	Pengaruh <i>Price Earning Ratio</i> Terhadap Harga Saham	54
BAB V		56
KESIMPULAN		56
5.1	Kesimpulan	56
5.2	Rekomendasi	57

DAFTAR PUSTAKA	58
LAMPIRAN.....	60

DAFTAR TABEL

Tabel 1.1 Harga Saham pada Perusahaan JII Pada periode 2012-2021	6
Tabel 1.2 Perkembangan Debt Equity Ratio (DER) pada perusahaan yang terdaftar di Jakarta Islamic Index (JII) periode 2012-2021	7
Tabel 1.3 Perkembangan Net Profit Margin (NPM) pada perusahaan yang terdaftar di Jakarta Islamic Index (JII) periode 2012-2021	8
Tabel 1.4 Perkembangan <i>Retrun on Equity</i> (ROE) pada perusahaan yang terdaftar di <i>Jakarta Islamic Index</i> (JII) periode 2012-2021.....	9
Tabel 1.5 Perkembangan Price Earning Ratio (PER) pada perusahaan yang terdaftar di Jakarta Islamic Index (JII) periode 2012-2021.....	10
Tabel 3.1 Definisi, Pengukuran, dan Satuan Variabel	33
Tabel 4.1 Hasil pengujian Uji Stasioneritas ADF Tingkat Level	38
Tabel 4.2 Hasil Pengujian Panjang Lag Optimum.....	38
Tabel 4.3 Uji Stabilitas VAR	40
Tabel 4.4 Uji Kausalitas Granger.....	40
Tabel 4.5 Hasil Uji Estimasi Vector Autoregressive	42
Tabel 4.6 Nilai <i>Implus Respon of</i> Harga saham.....	44
Tabel 4. 7 Hasil Uji Varian Decompesion of Harga Saham.....	47